

天弘现金管家货币市场基金2013年年度报告摘要

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3月27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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31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.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4	管理人报告.....	12
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	14
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	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7	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遵规守信情况声明.....	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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.....	21
7.4	报表附注.....	22
§8	投资组合报告.....	26
8.1	期末基金资产组合情况.....	26
8.2	债券回购融资情况.....	26
8.3	基金投资组合平均剩余期限.....	26
8.4	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	27
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.....	28
8.6	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	29
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....	29
8.8	投资组合报告附注.....	29
§9	基金份额持有人信息.....	31
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	31

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	31
§10 开放式基金份额变动	32
§11 重大事件揭示	33
11.1 基金份额持有人大会决议	33
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	33
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	33
11.4 基金投资策略的改变	33
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	33
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	33
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	33
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	34
§12 影响投资者决策的其他重要信息	35

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	846,975,272.00	
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类	天弘现金管家货币B类
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	262,491,973.67	584,483,298.33

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	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

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

§ 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6月20日-2012年12月31日	
	天弘现金管家 货币A类	天弘现金管家 货币B类	天弘现金管家 货币A类	天弘现金管家 货币B类
本期已实现收益	8,120,691.49	40,268,190.50	3,998,389.99	7,953,932.54
本期利润	8,120,691.49	40,268,190.50	3,998,389.99	7,953,932.54
本期净值收益率	3.9019%	4.1519%	1.6653%	1.7951%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末	
期末基金资产净值	262,491,973.67	584,483,298.33	340,333,423.67	375,543,731.55
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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。

3.2 基金净值表现

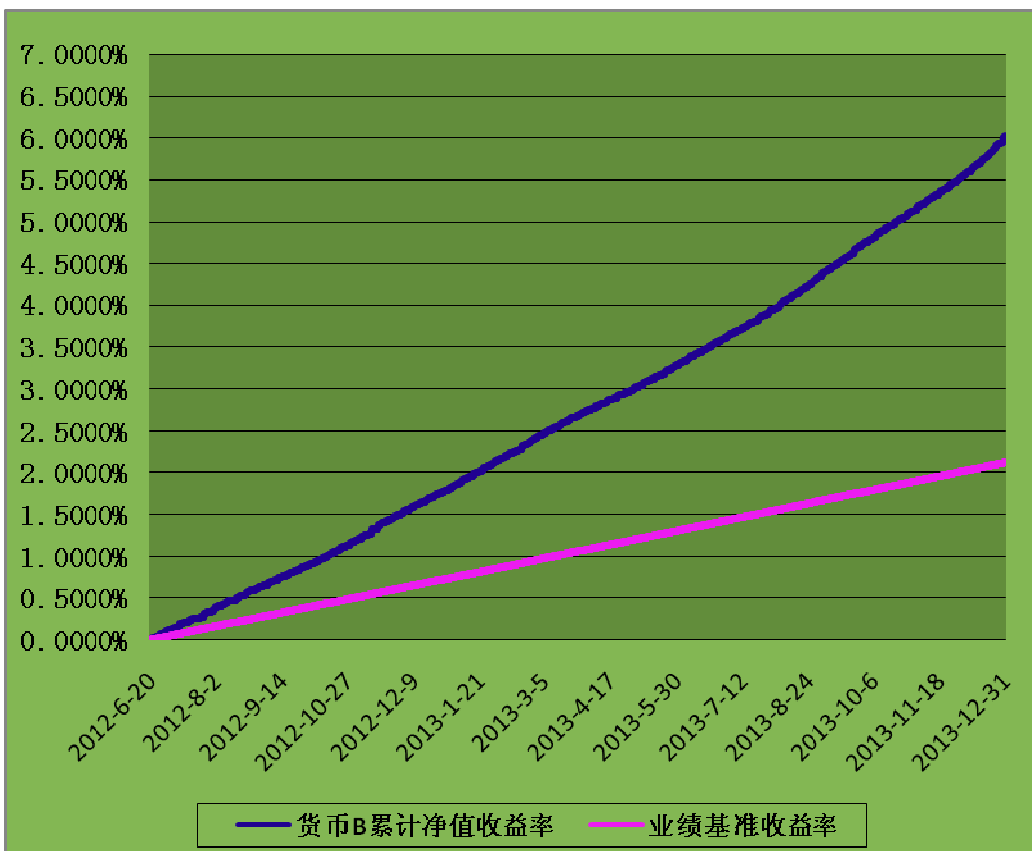
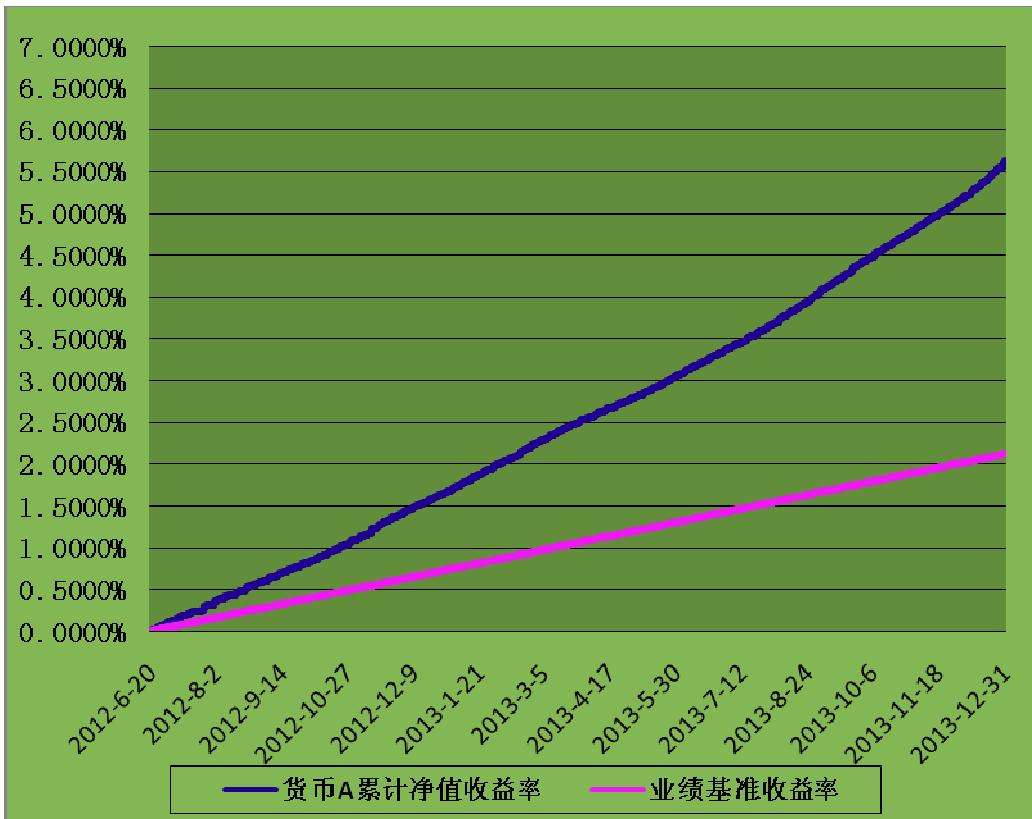
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 (天弘现金管家货币A类)	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	1.1606%	0.0078%	0.3456%	0.0000%	0.8150%	0.0078%
过去六个月	2.2105%	0.0075%	0.6924%	0.0000%	1.5181%	0.0075%
过去一年	3.9019%	0.0065%	1.3781%	0.0000%	2.5238%	0.0065%
自基金合同生效日起至今 (2012年06月20日-2013年 12月31日)	5.6322%	0.0069%	2.1240%	0.0000%	3.5082%	0.0069%

阶段 (天弘现金管家货币B类)	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	1.2218%	0.0078%	0.3456%	0.0000%	0.8762%	0.0078%
过去六个月	2.3338%	0.0075%	0.6924%	0.0000%	1.6414%	0.0075%
过去一年	4.1519%	0.0065%	1.3781%	0.0000%	2.7738%	0.0065%
自基金合同生效日起至今 (2012年06月20日-2013年 12月31日)	6.0215%	0.0069%	2.1240%	0.0000%	3.8975%	0.0069%

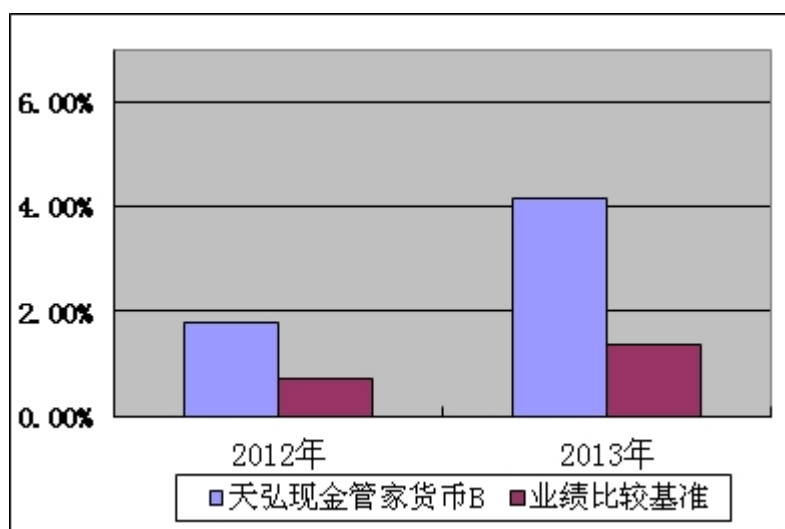
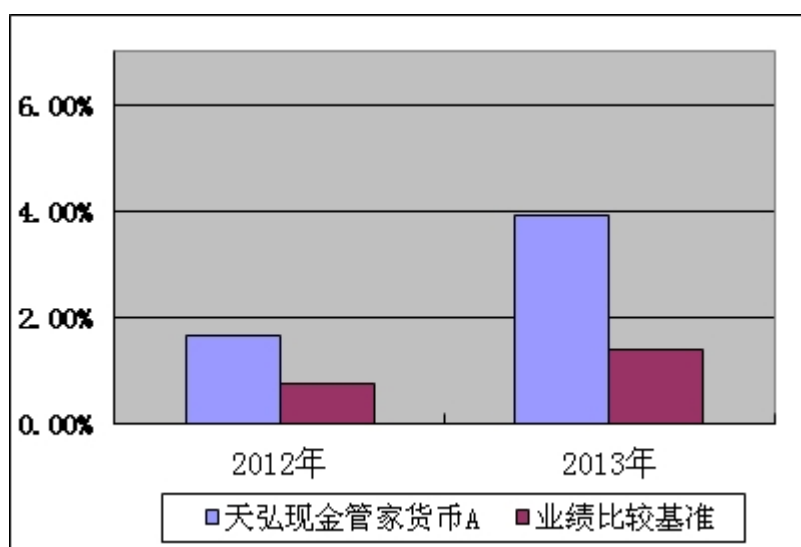
注：天弘现金管家货币市场基金业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）。通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期七天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

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



注：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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度 (天弘现金管家货币A类)	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
2013年	8,120,691.49	—	—	8,120,691.49	无
合计	12,119,081.48	—	—	12,119,081.48	无

单位：人民币元

年度 (天弘现金管家货币B类)	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
2013年	40,268,190.50	—	—	40,268,190.50	无
合计	48,222,123.04	—	—	48,222,123.04	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十四只基金：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		
王登峰	本基金基金经理、天弘增利宝货币市场基金基金经理。	2012年8月	—	4	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。
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；本公司股票投资部总经理助理。	2012年6月	2013年8月	7	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、上述日期分别为基金管理人对外披露的日期。

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，对于不同投资合同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

2013年一季度，我们判断资金面整体宽松，所以在年初银行时点紧张的时候，增加了逆回购和长期存款的配置。二季度，受财税缴款的季节性影响和外管局对套汇行为的规范，资金面有所收紧，4月份我们适度降低了组合久期，卖出部分期限较长的短融，在新增资产配置中，增持高流动性短融，严格控制单个资产的剩余期限，将组合久期降至历史低位，保证了基金安全度过了6月底的钱荒。2013年下半年，经历6月底流动性冲击以后，央行的货币政策维持了中性偏紧的态势，公开市场上“锁长放短”，续发到期3年央票，通过逆回购平滑资金面，整个货币市场资金价格较6月有所回落，但受6月流动性危机影响，机构均保持较高备付水平，导致资金供给下降，资金面维持偏紧的状态，利率中枢整体上移。因此银行同业存款的利率虽较6月有所下降，但是整体高于上半年平均水平；利率债在一级市场带动下，二级市场利率加速上行；短融收益率伴随资金利率的变化整体也较上半年有所抬升。所以2013年我们始终把流动性风险控制放在组合管理最首要的位置，严格控制组合久期，提高资产流动性，在风险可控的前提下，适度提高组合收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日，A级基金份额净值收益率3.9019%，B级基金份额净值收益率4.1519%，同期业绩比较基准收益率1.3781%。

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；短融收益率较去年整体中枢会有所下降，但需要关注个别风险事件的冲击；同业存款也会受银行调结构去杠杆的影响，对新增资金的需求下降，存款利率会随着下降。

投资策略上，本基金将继续坚守“稳健理财”的投资理念，将风险控制放在组合管理的首要位置，保持组合适度的久期，为持有人提供稳健、合理的收益。

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、投资总监、基金运营部负责人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、数量研究员、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、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

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,该所出具了“无保留意见的审计报告”,且在审计报告中无强调事项。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 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：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	466,070,221.97	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	370,110,979.50	300,521,611.20
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		370,110,979.50	300,521,611.20
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	—	158,500,597.75
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	8,241,417.55	5,459,976.17
应收股利		—	—
应收申购款		72,639,008.89	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		917,061,627.91	716,426,960.32
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		—	—
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		69,299,765.35	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		301,907.31	223,817.22
应付托管费		91,487.09	67,823.37
应付销售服务费		58,067.05	62,149.51
应付交易费用	7.4.7.7	20,050.08	22,015.00
应交税费		—	—
应付利息		6,079.03	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	309,000.00	174,000.00
负债合计		70,086,355.91	549,805.10
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	846,975,272.00	715,877,155.22
未分配利润	7.4.7.10	—	—
所有者权益合计		846,975,272.00	715,877,155.22
负债和所有者权益总计		917,061,627.91	716,426,960.32

注：报告截止日2013年12月31日，基金份额净值1.00元，天弘现金管家货币市场基金份额总额846,975,272.00份，其中天弘现金管家货币市场基金A级基金份额的份额总额为262,491,973.67份，天弘现金管家货币市场基金B级基金份额的份额总额为584,483,298.33份。

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：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至	上年度可比期间 2012年6月20日至
----	-----	------------------	------------------------

		2013年12月31日	2012年12月31日
一、收入		55,753,081.32	14,387,844.25
1.利息收入		46,456,125.44	10,634,909.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	26,626,456.11	7,255,343.78
债券利息收入		11,878,574.36	2,104,056.52
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		7,951,094.97	1,275,508.94
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,287,350.88	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	9,287,350.88	3,752,935.01
资产支持证券投资		—	—
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	—	—
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	9,605.00	—
减：二、费用		7,364,199.33	2,435,521.72
1. 管理人报酬		4,032,755.52	1,220,023.61
2. 托管费		1,222,047.19	369,704.08
3. 销售服务费		626,854.10	347,667.97
4. 交易费用	7.4.7.18	—	—
5. 利息支出		1,054,902.52	264,226.06
其中：卖出回购金融资产支出		1,054,902.52	264,226.06
6. 其他费用	7.4.7.19	427,640.00	233,900.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		48,388,881.99	11,952,322.53
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填		48,388,881.99	11,952,322.53

列)			
----	--	--	--

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：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2013年1月1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）	715,877,155.22	—	715,877,155.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		48,388,881.99	48,388,881.99
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）	131,098,116.78	—	131,098,116.78
其中：1.基金申购款	9,411,476,355.80	—	9,411,476,355.80
2.基金赎回款	-9,280,378,239.02	—	-9,280,378,239.02
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）	—	-48,388,881.99	-48,388,881.99
五、期末所有者权益（基金净值）	846,975,272.00	—	846,975,272.00
项 目	上年度可比期间2012年6月20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	—	-11,952,322.53	-11,952,322.53

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)	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

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

7.4.2 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("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
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("天方资产")	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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 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内未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间2012年6月20
----	----	------------------

	2013年1月1日至2013年12月31日	日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,032,755.52	1,220,023.61
其中: 支付销售机构的客户维护费	439,245.76	254,992.71

注: 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 X 0.33% / 当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间2012年6月20日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,222,047.19	369,704.08

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0.10%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 X 0.10% / 当年天数。

7.4.3.2.3 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1月1日至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘现金管家货币A类	天弘现金管家货币B类	合计
天弘基金管理有限公司	86,395.81	80,970.00	167,365.81
中国邮政储蓄银行	272,140.31	1,579.11	273,719.42
合计	358,536.12	82,549.11	441,085.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2012年6月20日至2012年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	天弘现金管家货币 A类	天弘现金管家货币 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：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级基金份额和B级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。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.3.4.2 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

份额单位：人民币元

关联方名称		本期末 2013年12月31日		上年度末 2012年12月31日	
		持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
天弘 现金 管家 货币 B类	天方资产	5116261.93	0.88%	0	—

7.4.3.5 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1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间2012年6月20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	1,070,221.97	39,995.79	1,944,775.20	61,694.31

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。

7.4.3.6 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。

7.4.3.7 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。

7.4.4 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 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/增发证券而流通受限的证券。

7.4.4.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止，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69,299,765.35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
130201	13国开01	2014-01-02	99.99	300000	29,997,000.00
130210	13国开10	2014-01-02	99.84	200000	19,968,000.00
130214	13国开14	2014-01-02	99.69	200000	19,938,000.00
合计				700,000.00	69,903,000.00

7.4.4.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止，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。

§ 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	370,110,979.50	40.36
	其中：债券	370,110,979.50	40.36
	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	466,070,221.97	50.82
4	其他各项资产	80,880,426.44	8.82
5	合计	917,061,627.91	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	2.42	
	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	69,299,765.35	8.18
	其中：买断式回购融资	—	—

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	35
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	5

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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	70.38	8.18
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	2.36	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	25.98	—
	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	98.72	8.18

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	69,967,562.18	8.26
	其中：政策性金融债	69,967,562.18	8.26
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	300,143,417.32	35.44
6	中期票据	—	—
7	其他	—	—
8	合计	370,110,979.50	43.70
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	041369007	13北控集CP001	500,000	50,050,209.36	5.91
2	011322003	13神华SCP003	500,000	49,953,308.66	5.90
3	011309009	13国电集SCP009	400,000	39,974,582.16	4.72
4	041360003	13陕高速CP001	300,000	30,042,280.70	3.55
5	041358032	13沪打捞CP001	300,000	30,031,163.46	3.55
6	041355007	13金隅CP001	300,000	30,030,927.77	3.55
7	041359002	13苏豪CP001	300,000	30,025,014.60	3.55
8	130201	13国开01	300,000	30,000,562.81	3.54

9	0413700 01	13沪强生 CP001	200,000	20,024,401.93	2.36
10	0413590 01	13绍黄酒 CP001	200,000	20,011,528.68	2.36

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	—
报告期内偏离度的最高值	0.1692
报告期内偏离度的最低值	-0.0930
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0731

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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 本报告期内，本基金未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。

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
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	8,241,417.55
4	应收申购款	72,639,008.89
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	80,880,426.44

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
天弘现金管 家货币A类	9,269	28,319.34	14,541,202.43	5.54%	247,950,771.24	94.46%
天弘现金管 家货币B类	26	22,480,126.86	498,859,359.03	85.35%	85,623,939.30	14.65%
合计	9,295	91,121.60	513,400,561.46	60.62%	333,574,710.54	39.38%

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开放式基金的情况

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 有本开放式基金	天弘现金管家 货币A类	258,387.20	0.09%
	天弘现金管家 货币B类	—	—
	合计	258,387.20	0.03%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	天弘现金管家货币A类	天弘现金管家货币B类
基金合同生效日(2012年6月20日)基金份额总额	576,166,940.77	658,270,316.20
本报告期期初基金份额总额	340,333,423.67	375,543,731.55
本报告期期间基金总申购份额	2,128,350,269.73	7,283,126,086.07
减：本报告期期间基金总赎回份额	2,206,191,719.73	7,074,186,519.29
本报告期期间基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	262,491,973.67	584,483,298.33

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有限公司支付服务费玖万元整。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1年7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	债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

民生证券	1	-	-	100,000.00	100.00%	-	-
------	---	---	---	------------	---------	---	---

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 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注：本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§ 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。

天弘基金管理有限公司
二〇一四年三月二十七日