# 天弘永利债券型证券投资基金

## 2012 年度报告摘要

**基金管理人：天弘基金管理有限公司**
**基金托管人：兴业银行股份有限公司**
**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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月27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2012年1月1日起至2012年12月31日止。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 天弘永利债券 | |
| 基金主代码 | 420002 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2008年4月18日 | |
| 基金管理人 | 天弘基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,026,799,279.84份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 天弘永利债券A | 天弘永利债券B |
| 下属分级基金的交易代码 | 420002 | 420102 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 730,598,995.95份 | 296,200,283.89份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在充分控制风险和保持资产良好流动性的前提下，力争为基金份额持有人获取较高的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金通过对宏观经济自上而下的分析以及对微观面自下而上的分析，对宏观经济发展环境、宏观经济运行状况、货币政策和财政政策的变化、市场利率走势、经济周期、企业盈利状况等作出研判，从而确定整体资产配置，即债券、股票、现金及回购等的配置比例。本基金的股票投资将以新股申购为主，对于二级市场股票投资持谨慎态度。本基金将在充分重视本金安全的前提下，为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。 |
| 业绩比较基准 | 中信标普全债指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券市场中风险较低的品种，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、高于货币市场基金。 |

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 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 童建林 | 张志永 |
| | 联系电话 | 022-83310208 | 021-62677777＊212004 |
| | 电子邮箱 | service@thfund.com.cn | zhangzhy@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 022-83310988，4007109999 | 95561 |
| 传真 | | 022-83865569 | 021-62159217 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 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

3.1.1天弘永利债券A类

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2012年 | 2011年 | 2010年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 113,628,742.73 | -1,239,718.75 | 2,683,376.81 |
| 本期利润 | 123,277,155.76 | -978,468.85 | 1,931,045.93 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0752 | -0.0203 | 0.0365 |
| 本期基金份额净值增长率 | 7.39% | -1.32% | 5.00% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2012年末 | 2011年末 | 2010年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0061 | -0.0099 | 0.0033 |
| 期末基金资产净值 | 735,083,576.85 | 114,067,392.38 | 154,950,617.75 |
| 期末基金份额净值 | 1.0061 | 0.9901 | 1.0033 |

3.1.2天弘永利债券B类

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2012年 | 2011年 | 2010年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 23,045,142.66 | 74,247.81 | 1,558,954.46 |
| 本期利润 | 23,055,936.99 | -168,024.55 | 1,668,008.07 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0719 | -0.0344 | 0.0522 |
| 本期基金份额净值增长率 | 7.89% | -0.91% | 5.44% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2012年末 | 2011年末 | 2010年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0069 | -0.0055 | 0.0036 |
| 期末基金资产净值 | 298,237,033.90 | 7,380,694.31 | 35,058,536.35 |
| 期末基金份额净值 | 1.0069 | 0.9945 | 1.0036 |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.1.1天弘永利债券A类

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.52% | 0.04% | 1.02% | 0.02% | 0.50% | 0.02% |
| 过去六个月 | 1.30% | 0.06% | 1.12% | 0.03% | 0.18% | 0.03% |
| 过去一年 | 7.39% | 0.07% | 4.03% | 0.04% | 3.36% | 0.03% |
| 过去三年 | 11.28% | 0.12% | 10.13% | 0.06% | 1.15% | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.15% | 0.17% | 18.72% | 0.07% | 1.43% | 0.10% |

3.2.1.2天弘永利债券B类

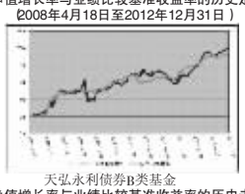
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.67% | 0.04% | 1.02% | 0.02% | 0.65% | 0.02% |
| 过去六个月 | 1.55% | 0.06% | 1.12% | 0.03% | 0.43% | 0.03% |
| 过去一年 | 7.89% | 0.07% | 4.03% | 0.04% | 3.86% | 0.03% |
| 过去三年 | 12.73% | 0.12% | 10.13% | 0.06% | 2.60% | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.63% | 0.17% | 18.72% | 0.07% | 3.91% | 0.10% |

注：天弘永利债券基金业绩比较基准：中信标普全债指数。中信标普全债指数是一个全面反映整个债券市场（交易所债券市场、银行间债券市场）的综合性权威债券指数。针对我国债券市场，尤其是银行间债券市场流动性不足的问题，中信标普全债指数没有包含所有在银行间债券市场上市交易的品种，而是选择了部分交投比较活跃的银行间债券品种作为样本券，这样就更能够敏锐、直接、全面地反映市场对利率的预期及市场的走势。

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

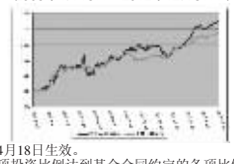
3.2.2.1 天弘永利债券A类基金

**份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图**
**（2008年4月18日至2012年12月31日）**



3.2.2.2 天弘永利债券B类基金

**份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图**
**（2008年4月18日至2012年12月31日）**

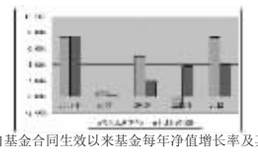


注：1、本基金合同于2008年4月18日生效。

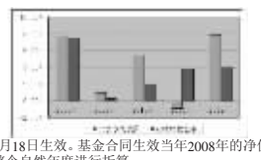
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3.2.3 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

3.2.3.1天弘永利债券A类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



3.2.3.2天弘永利债券B类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



注：本基金合同于2008年4月18日生效。基金合同生效当年2008年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

天弘永利债券A类

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2012年 | 0.559 | 65,799,240.62 | 56,580,077.25 | 122,379,317.87 | 无 |
| 2011年 | - | - | - | - | 无 |
| 2010年 | 0.521 | 4,069,660.51 | 374,734.91 | 4,444,395.42 | 无 |
| 合计 | 1.080 | 69,868,901.13 | 56,954,812.16 | 126,823,713.29 | 无 |

天弘永利债券B类

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2012年 | 0.644 | 25,344,504.82 | 3,609,004.74 | 28,953,509.56 | 无 |
| 2011年 | - | - | - | - | 无 |
| 2010年 | 0.562 | 1,630,333.03 | 109,637.68 | 1,739,970.71 | 无 |
| 合计 | 1.206 | 26,974,837.85 | 3,718,642.42 | 30,693,480.27 | 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 | | |
| 陈钢 | 本基金基金经理；天弘添利分级债券型证券投资基金基金经理；天弘丰利分级债券型证券投资基金基金经理；固定收益总监兼固定收益部总经理。 | 2011年11月 | — | 10年 | 男，工商管理硕士。历任华龙证券公司固定收益部高级经理；北京辰星投资管理公司投资经理；兴业证券公司债券总部研究部经理；银华基金管理有限公司机构理财部高级经理；中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2011年加盟本公司。 |
| 姜晓丽 | 本基金基金经理。 | 2012年8月 | — | 3年 | 女，经济学硕士。历任本公司债券研究员兼债券交易员；光大永明人寿保险有限公司债券研究员兼交易员；本公司固定收益研究员、本基金基金经理助理。 |
| 刘冬 | 本基金基金经理助理；天弘丰利分级债券型证券投资基金基金经理；天弘现金管家货币市场基金基金经理；天弘债券型发起式证券投资基金基金经理；股票投资部总经理助理。 | 2009年3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。 |

注：1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

2012年，债市整体上涨，但品种分化严重，市场结构也出现了显著变化。直接融资进一步兴起，企业债和城投债发行量显著增加，银行理财资金成为信用债的投资主力。利率产品全年收益有限，信用产品尤其是中低评级信用债和城投债全年收益丰厚。

2012年基金净值上涨7.42%，全年业绩整体平稳，但在3季度市场调整且规模变动剧烈的情况下有较大幅度的调整。在2012年年初，我们认为经济下滑、物价压力缓解并带来政策的宽松，债市将迎来一轮牛市，且中低评级空间更大。我们在全年以中等评级信用债配置为主，少量参与利率品波段和可转债、新股的投资机会。在一季度中期大量参与城投债配置，在一季度和二季度初期采取了较为激进的配置策略，获得了较好的收益；在二季度中后期进行调整，降低仓位和久期，转为防守，但由于市场整体调整，基金规模变动较大，仓位被动增加，使得净值出现下跌；三季度末期，在市场收益率上升后，信用品价值再度显现，我们仅进行了少量增仓，维持稳健的投资策略，并持续到四季度。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日，本基金A类份额净值为1.0061元，B类份额净值为1.0069元。本报告期A类基金份额净值增长率7.39%，B类基金份额净值增长率7.89%，同期业绩比较基准增长率4.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年，经济有望在库存周期和基建投资的拉动下继续恢复，物价也有温和回升的压力，货币政策维持稳定、财政政策整体积极。但具体的改革和政策实施具有很大的不确定性，使得宏观经济本身的判断也有较大的不确定性。对于债券市场而言，供给结构和需求结构可能面临较大的变化，同时风险偏好的提高对债市造成一定压力，但投资者结构的被动投资压力可能成为支持中低评级信用债的因素。当前债券收益率普遍合理，进一步下行空间有限，债券尤其是中低评级信用债开始具有一定的泡沫特征。

在诸多不确定性的条件下，我们将采取更为灵活的投资策略，对可能的变化以应对为主。我们将维持较低的久期，维持灵活的配置结构，保留部分高收益个券作为底仓配置，更多偏重流动性管理，为后期可能出现的交易机会做好准备。具体配置上，保持偏低的仓位和偏低的久期，对可能带来超额收益的转债和股票，我们仍谨慎对待，不会进行大量的配置。争取为投资人获得稳定的、能够持续的收益。

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、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《基金法》、《天弘永利债券型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金进行了四次分红。以2012年3月16日它实现的可分配收益7,352,753.85元为基准计算，2012年3月23日向天弘永利债券A基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.1090元，向天弘永利债券B基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.160元；以2012年5月7日已实现的可分配收益44,689,643.62元为基准计算，2012年5月15日向天弘永利债券A基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.153元，向天弘永利债券B基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.161元；以2012年6月28日已实现的可分配收益43,950,322.95元为基准计算，2012年7月9日向天弘永利债券A基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.118元，向天弘永利债券B基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.122元；以2012年12月11日已实现的可分配收益30,535,417.70元为基准计算，2012年12月18日向天弘永利债券A基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.179元，向天弘永利债券B基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.201元。四次分红均符合本基金基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

### §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

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

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

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

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 | 上年度末 2011年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 13,750,459.84 | 15,086,182.49 |
| 结算备付金 | | 20,445,348.21 | 883,370.49 |
| 存出保证金 | | 250,000.00 | 6,431.95 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 1,306,755,676.54 | 113,999,646.54 |
| 其中：股票投资 | | 30,000.00 | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,306,725,676.54 | 113,999,646.54 |
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 33,533,708.63 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 31,171,199.28 | 1,650,384.62 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 8,150,615.13 | 5,592,985.70 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,414,057,007.63 | 137,219,001.79 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2012年12月31日 | 上年度末 2011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 | | 331,999,794.20 | 200,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 39,097,012.49 | 14,688,333.35 |
| 应付赎回款 | | 7,207,541.57 | 1,000.50 |
| 应付管理人报酬 | | 942,307.01 | 28,817.88 |
| 应付托管费 | | 269,230.61 | 8,233.69 |
| 应付销售服务费 | | 341,129.45 | 15,200.64 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 11,327.16 | 937.77 |
| 应交税费 | | 313,404.89 | 313,395.10 |
| 应付利息 | | - | 7.20 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 554,649.50 | 514,988.97 |
| 负债合计 | | 380,736,396.88 | 15,770,915.10 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 1,026,799,279.84 | 122,634,225.30 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 6,521,330.91 | -1,186,138.61 |
| 所有者权益合计 | | 1,033,320,610.75 | 121,448,086.69 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,414,057,007.63 | 137,219,001.79 |

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额总额1,026,799,279.84元，天弘永利债券A类基金份额净值1.0061元，基金份额总额730,598,995.95份；天弘永利债券B类基金份额净值1.0069元，基金份额总额296,200,283.89份。

7.2 利润表

会计主体：天弘永利债券型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 181,617,954.13 | 338,145.82 |
| 1. 利息收入 | | 106,379,947.58 | 1,985,351.03 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 1,968,321.17 | 55,741.99 |
| 债券利息收入 | | 103,318,200.08 | 1,916,121.40 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,093,426.33 | 13,487.64 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益(损失以“-”填列) | | 65,312,676.80 | -1,666,233.13 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | -2,049,882.34 | -76,890.37 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 67,362,469.14 | -1,589,787.90 |
| 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 | 90.00 | 445.14 |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 7.4.7.16 | 9,659,207.36 | 18,977.54 |
| 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 | 266,122.39 | 50.38 |
| 减：二、费用 | | 35,284,861.38 | 1,484,639.22 |
| 1. 管理人报酬 | | 13,519,683.37 | 376,409.69 |
| 2. 托管费 | | 3,862,766.77 | 107,545.58 |
| 3. 销售服务费 | | 6,459,439.27 | 195,166.81 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 162,735.07 | 35,682.51 |
| 5. 利息支出 | | 10,747,201.04 | 383,490.44 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 10,747,201.04 | 383,490.44 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.19 | 533,035.86 | 386,344.19 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 146,333,092.75 | -1,146,493.40 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 146,333,092.75 | -1,146,493.40 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘永利债券型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1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) | 122,634,225.30 | -1,186,138.61 | 121,448,086.69 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 146,333,092.75 | 146,333,092.75 |
| 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) | 904,165,054.54 | 12,707,204.20 | 916,872,258.74 |
| 其中：1.基金申购款 | 14,883,943,371.49 | 219,768,491.77 | 15,103,711,863.26 |
| 2.基金赎回款 | -13,979,778,316.95 | -207,061,287.57 | -14,186,839,604.52 |
| 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) | - | -151,332,827.43 | -151,332,827.43 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,026,799,279.84 | 6,521,330.91 | 1,033,320,610.75 |
| 项目 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011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) | 189,370,000.23 | 639,153.87 | 190,009,154.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -1,146,493.40 | -1,146,493.40 |
| 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) | -66,735,774.93 | -678,799.08 | -67,414,574.01 |
| 其中：1. 基金申购款 | 311,946,467.05 | -1,902,005.97 | 310,044,461.08 |
| 2. 基金赎回款 | -378,682,241.98 | 1,223,206.89 | -377,459,035.09 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 122,634,225.30 | -1,186,138.61 | 121,448,086.69 |

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 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 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 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。

7.4.3 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

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.3.2 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 2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 13,519,683.37 | 376,409.69 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,264,104.19 | 81,435.03 |

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

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

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,862,766.77 | 107,545.58 |

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

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 2012年1月1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 | 578,244.76 | - | 578,244.76 |
| 兴业银行 | 56,815.72 | - | 56,815.72 |
| 合计 | 635,060.48 | - | 635,060.48 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011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 | 8,641.30 | - | 8,641.30 |
| 兴业银行 | 63,138.55 | - | 63,138.55 |
| 合计 | 71,779.85 | - | 71,779.85 |

注：1、本基金A类基金支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.40 % / 当年天数。

2、本基金B类基金份额不收取销售服务费。

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

本基金本期及上年度可比期间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

天弘永利债券型证券投资基金A类基金

本基金本年度及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资天弘永利债券型证券投资基金A类基金的情况。

天弘永利债券型证券投资基金B类基金

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | - | 10,000,000.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | 10,000,000.00 |
| 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 | - | - |

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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.5 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 2012年1月1日至2012年12月31日 | | 上年度可比期间 2011年1月1日至2011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 |
| 兴业银行 | 13,750,459.84 | 1,465,230.31 | 15,086,182.49 | 36,875.22 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.4 期末（2012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

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位：张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 127001 | 海直转债 | 12/12/24 | 13/01/07 | 网下新债申购 | 100.00 | 100.00 | 32,110 | 3,211,000.00 | 3,211,