

# 天弘永利债券型证券投资基金

## [2014] 第二季度报告

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:2014年07月21日

### § 1 重要提示

本基金报告期内,严格执行控制同一基金不同份额之间的同日买卖交易,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,对非公开发行股票中的中申购、中赎回、中申购、中赎回等进行审慎评估,并根据规定符合公平交易原则,未发现本基金存在异常交易行为。

基金管理人的董事会及基金经理保证本基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金管理人和基金托管人根据本基金合同规定,于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期财务报表未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

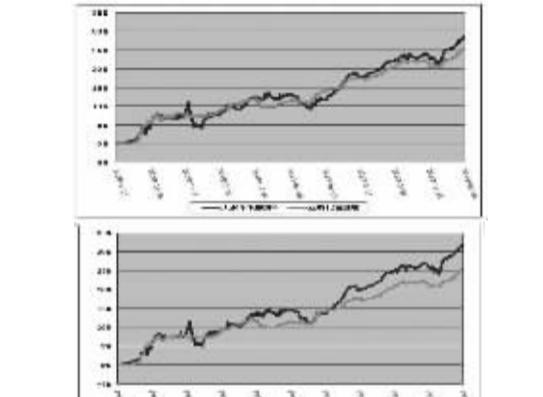
### § 2 基金产品概况

基金简称	天弘永利债券
交易代码	420002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年04月18日
报告期末基金份额总额	357,641,900.96
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得较高的投资回报。
投资策略	本基金通过对宏观经济、政策、市场走势、经济周期、企业盈余状况等进行分析,把握整体经济运行趋势,从而选择具有较好配置价值的行业,并在此基础上精选个股,以期实现资产的保值增值。本基金将主要在注重资本安全的前提下,为基金份额持有人创造长期稳定的回报。
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。
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
下属两级基金的基金简称	天弘永利债券A 天弘永利债券B
下属两级基金的交易代码	420002 420102
报告期末下属两级基金的份额总额	183,804,587.06 173,844,313.40
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2014年04月01日-2014年06月30日)				
天弘永利债券A 天弘永利债券B						
1.本期已实现收益		3,162,276.38	2,184,535.93			
2.期末利润		6,404,605.51	4,241,452.10			
3.加权平均基金份额本期利润		0.0276	0.0278			
4.期末基金份额净值		189,278,654.70	179,587,447.25			
5.期末基金份额净值		1.0322	1.0300			
注:1.本期已实现收益指基金收入扣除费用后的余额,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润即本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 2.所列基金业报酬包括但不限于从认购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仍为零的数字。 3.基金净值的表现形式。						
3.21 本期报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
天弘永利债券A						
阶段	净值增长 率①	净值增长 率标准差 ②	业绩比较 基准收益率 标准差③	业绩比较 基准收益率 标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.59%	0.09%	2.41%	0.04%	0.31%	0.05%
天弘永利债券B						
阶段	净值增 长①	净值增 长标准差 ②	业绩比 较基准收 益率标准差 ③	业绩比 较基准收 益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	2.72%	0.09%	2.41%	0.04%	0.31%	0.05%
3.22 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较						
天弘永利债券A						
阶段	净值增 长①	净值增 长标准差 ②	业绩比 较基准收 益率标准差 ③	业绩比 较基准收 益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	2.59%	0.09%	2.41%	0.04%	0.18%	0.05%
天弘永利债券B						
阶段	净值增 长①	净值增 长标准差 ②	业绩比 较基准收 益率标准差 ③	业绩比 较基准收 益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	2.72%	0.09%	2.41%	0.04%	0.31%	0.05%



注:1.本基金合同于2008年4月18日生效。  
2.本报告期内,本基金的各项投向比例均符合基金合同的各项比例限制。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

4.2 公司高级管理人员简介

4.3 公司主要股东情况

4.4 公司治理情况

4.5 公司内部控制制度

4.6 公司督察长履行职责情况说明

4.7 公司高级管理人员声明

4.8 公司基金经理声明

4.9 公司基金经理助理声明

4.10 公司监察稽核人员声明

4.11 公司高级管理人员声明

4.12 公司督察长声明

4.13 公司总经理声明

4.14 公司副总经理声明

4.15 公司财务总监声明

4.16 公司合规总监声明

4.17 公司风险管理部总经理声明

4.18 公司客户服务部总经理声明

4.19 公司信息技术部总经理声明

4.20 公司监察稽核部总经理声明

4.21 公司风险管理部总经理声明

4.22 公司监察稽核部总经理声明

4.23 公司监察稽核部总经理声明

4.24 公司监察稽核部总经理声明

4.25 公司监察稽核部总经理声明

4.26 公司监察稽核部总经理声明

4.27 公司监察稽核部总经理声明

4.28 公司监察稽核部总经理声明

4.29 公司监察稽核部总经理声明

4.30 公司监察稽核部总经理声明

4.31 公司监察稽核部总经理声明

4.32 公司监察稽核部总经理声明

4.33 公司监察稽核部总经理声明

4.34 公司监察稽核部总经理声明

4.35 公司监察稽核部总经理声明

4.36 公司监察稽核部总经理声明

4.37 公司监察稽核部总经理声明

4.38 公司监察稽核部总经理声明

4.39 公司监察稽核部总经理声明

4.40 公司监察稽核部总经理声明

4.41 公司监察稽核部总经理声明

4.42 公司监察稽核部总经理声明

4.43 公司监察稽核部总经理声明

4.44 公司监察稽核部总经理声明

4.45 公司监察稽核部总经理声明

4.46 公司监察稽核部总经理声明

4.47 公司监察稽核部总经理声明

4.48 公司监察稽核部总经理声明

4.49 公司监察稽核部总经理声明

4.50 公司监察稽核部总经理声明

4.51 公司监察稽核部总经理声明

4.52 公司监察稽核部总经理声明

4.53 公司监察稽核部总经理声明

4.54 公司监察稽核部总经理声明

4.55 公司监察稽核部总经理声明

4.56 公司监察稽核部总经理声明

4.57 公司监察稽核部总经理声明

4.58 公司监察稽核部总经理声明

4.59 公司监察稽核部总经理声明

4.60 公司监察稽核部总经理声明

4.61 公司监察稽核部总经理声明

4.62 公司监察稽核部总经理声明

4.63 公司监察稽核部总经理声明

4.64 公司监察稽核部总经理声明

4.65 公司监察稽核部总经理声明

4.66 公司监察稽核部总经理声明

4.67 公司监察稽核部总经理声明

4.68 公司监察稽核部总经理声明

4.69 公司监察稽核部总经理声明

4.70 公司监察稽核部总经理声明

4.71 公司监察稽核部总经理声明

4.72 公司监察稽核部总经理声明

4.73 公司监察稽核部总经理声明

4.74 公司监察稽核部总经理声明

4.75 公司监察稽核部总经理声明

4.76 公司监察稽核部总经理声明

4.77 公司监察稽核部总经理声明

4.78 公司监察稽核部总经理声明

4.79 公司监察稽核部总经理声明

4.80 公司监察稽核部总经理声明

4.81 公司监察稽核部总经理声明

4.82 公司监察稽核部总经理声明

4.83 公司监察稽核部总经理声明

4.84 公司监察稽核部总经理声明

4.85 公司监察稽核部总经理声明

4.86 公司监察稽核部总经理声明

4.87 公司监察稽核部总经理声明

4.88 公司监察稽核部总经理声明

4.89 公司监察稽核部总经理声明

4.90 公司监察稽核部总经理声明

4.91 公司监察稽核部总经理声明

4.92 公司监察稽核部总经理声明

4.93 公司监察稽核部总经理声明</