天弘弘利债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:北京银行股份有限公司
日 期:二〇一八年十月

重要提示

天弘弘利债券型证券投资基金(以下简称"基金"或"本基金")于2013年7月31日经中国证监会证监许可[2013]1029号文核准募集。中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。本基金的基金合同于2013年9月11日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

投资有风险,投资者认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

风险提示:

证券投资基金是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益,并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;本基金对股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%,其中,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%。

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构购买基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金投资的"买者自负"原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化、基金份额上市交易价格波动引致的投资风险,由投资者自行负担。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并按监管要求履行相关程序。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金招募说明书自基金合同生效之日起,每6个月更新一次,并于每6个月结束之日后的45日内公告。本招募说明书所载内容截止日为2018年09月11日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年06月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:天弘基金管理有限公司
住所:天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241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
成立日期:2004年11月8日
法定代表人:井贤栋
客服电话:95046
联系人:司媛
组织形式:有限责任公司
注册资本及股权结构:

天弘基金管理有限公司(以下简称"公司"或"本公司")经中国证券监督管理委员会批准(证监基金字[2004]164号),于2004年11月8日成立。公司注册资本为人民币5.143亿元,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股份有限公司	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%

(二)主要人员情况

1、董事会成员基本情况

井贤栋先生,董事长,硕士研究生。历任太古饮料有限公司财务总监、广州百事可乐有限公司首席财务官、阿里巴巴(中国)信息技术有限公司财务副总裁、支付宝(中国)网络技术有限公司首席财务官,浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司首席运营官,现任浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司董事长兼总经理。

卢信群先生,副董事长,硕士研究生。历任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、副总经理、财务总监、董事会秘书,北京博晖创新光电技术股份有限公司监事。现任北京博晖创新光电技术股份有限公司董事、总经理,君正国际投资(北京)有限公司董事,河北大安制药有限公司董事,广东卫伦生物制药有限公司董事。

屠剑威先生,董事,硕士研究生。历任中国工商银行浙江省分行营业部法律事务处案件管理科副科长、香港永亨银行有限公司上海分行法律合规监察部经理、花旗银行(中国)有限公司合规部助理总裁、永亨银行(中国)有限公司法律合规部主管。现任浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司法务及合规部高级研究员。

祖国明先生,董事,大学本科。历任中国证券市场研究设计中心工程师、和讯信息科技有限公司COO助理、浙江淘宝网络有限公司总监。现任支付宝(中国)网络技术有限公司北京分公司资深总监。

付岩先生,董事,大学本科。历任北洋(天津)物产集团有限公司期货部交易员,中国经济开发信托投资公司天津证券部投资部职员,顺驰(中国)地产有限公司资产管理部高级经理、天津信托有限责任公司投资银行部项目经理。现任天津信托有限责任公司总经理助理、自营业务部总经理、投资发展部总经理。

郭树强先生,董事,总经理,硕士研究生。历任华夏基金管理有限公司交易主管、基金经理、研究总监、机构投资总监、投资决策委员会委员、机构投资决策委员会主任、公司管委会委员、公司总经理助理。现任本公司总经理。

魏新顺先生,独立董事,大学本科。历任天津市政府法制办执法监督处副处长,天津市政府法制办经济法规处处长,天津达天律师事务所律师。现任天津英联律师事务所主任律师。

张军先生,独立董事,博士。现任复旦大学经济学院教授。

贺强先生,独立董事,本科。现任中央财经大学金融学院教授。

2、监事会成员基本情况

李琦先生,监事会主席,硕士研究生。历任天津市民政局事业处团委副书记,天津市人民政府法制办公室、天津市外经贸委办公室干部,天津信托有限责任公司条法处处长、总经理助理兼条法处处长,副总经理,本公司董事长。

张杰先生,监事,注册会计师、注册审计师。现任内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理,锡林浩特市君正能源化工有限责任公司董事长,锡林郭勒盟君正能源化工有限责任公司执行董事、总经理,内蒙古君正化工有限责任公司监事,乌海市君正矿业有限责任公司监事,内蒙古坤德物流股份有限公司监事,内蒙古君正天原化工有限责任公司监事,内蒙古君正互联网小额贷款有限公司董事长。

李渊,监事,硕士研究生。历任北京朗山律师事务所律师。现任芜湖高新投资有限公司法务总监。

韩海潮先生,监事,硕士研究生。历任三峡证券天津白堤路营业部、勤俭道营业部信息技术部经理,亚洲证券天津勤俭道营业部营运总监。现任本公司运营总监、信息技术总监。

张牡霞女士,监事,硕士研究生。历任新华社上海证券报财经要闻部记者、本公司市场部电子商务专员、电子商务部业务拓展主管、总经理助理,现任本公司互联网金融业务部总经理。

付颖女士,监事,硕士研究生。历任本公司内控合规部信息披露专员、法务专员、合规专员、高级合规经理、部门主管。现任本公司内控合规部总经理。

3、高级管理人员基本情况

郭树强先生,董事,总经理,简历参见董事会成员基本情况。

陈钢先生,副总经理,硕士研究生。历任华龙证券公司固定收益部高级经理,北京宸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7月份加盟本公司,现任公司副总经理、固定收益总监、资深基金经理,分管公司固定收益投资业务。

周晓明先生,副总经理,硕士研究生。历任中国证券市场研究院设计中心及其下属北京标准股份制咨询公司经理,万通企业集团总裁助理,中工信托有限公司投资部副总,国信证券北京投资银行一部经理,北京证券投资银行部副总,嘉实基金市场部副总监、渠道部总监,香港汇富集团高级副总裁,工银瑞信基金市场部副总监,嘉实基金产品和营销总监,盛世基金拟任总经理。2011年8月加盟本公司,同月被任命为公司首席市场官,现任公司副总经理,分管公司电子商务及产品业务。

熊军先生,副总经理,财政学博士。历任中央教育科学研究所助理研究员,国家国有资产管理局主任科员、副处长,财政部干部教育中心副处长,全国社保基金理事会副处长、处长、副主任、巡视员。2017年3月加盟本公司,任命为公司首席经济学家,现任公司副总经理,分管智能投资部及养老金业务。

童建林先生,督察长,大学本科,高级会计师。历任当阳市产权证券交易中心财务部经理、副总经理,亚洲证券有限责任公司宜昌总部财务主管、宜昌营业部财务部经理、公司财务会计总部财务主管,华泰证券有限责任公司上海总部财务项目主管。2006年8月加盟本公司,历任基金会计、内控合规部副总经理、内控合规部总经理。现任本公司督察长。

4、本基金基金经理

姜晓丽女士,经济学硕士,9年证券从业经验。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,天弘永利债券型证券投资基金基金经理助理、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2015年6月至2017年8月)、天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年12月至2018年3月)、天弘瑞利分级债券型证券投资基金基金经理(2015年1月至2018年3月)、天弘天盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017年5月至2018年6月)、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年11月至2018年8月)、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年11月至2018年9月)、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年12月至2018年9月)。现任天弘永利债券型证券投资基金基金经理、天弘安康颐养混合型证券投资基金基金经理、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金基金经理、天弘通利混合型证券投资基金基金经理、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理、天弘信利债券型证券投资基金基金经理、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘弘利债券型证券投资基金基金经理、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、天弘悦享定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、天弘添利债券型证券投资基金(LOF)基金经理。

王林先生,工商管理硕士,17年证券从业经验。历任长城证券有限责任公司分析师、嘉实基金管理有限公司研究员、中国人寿资产管理公司投资经理、建信基金管理有限公司投资经理。2014年11月加盟本公司,历任本公司机构投资部副总经理、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年3月至2017年8月)。现任天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、天弘弘利债券型证券投资基金基金经理。

历任基金经理:
陈钢,任职时间:2013年9月11日至2017年4月17日。
凌超,任职时间:2016年5月14日至2017年7月13日。

5、基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

陈钢先生,本公司副总经理,投资决策委员会联席主席、固定收益总监、基金经理。
熊军先生,本公司副总经理,投资决策委员会联席主席、公司首席经济学家。
邓强先生,首席风控官。
肖志刚先生,股票投资总监,基金经理。
黄颖女士,研究总监。
王登峰先生,固定收益部总经理,基金经理。
钱文成先生,基金经理。
刘冬先生,基金经理。
陈国光先生,基金经理。
姜晓丽女士,基金经理。
王林先生,基金经理。
上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

1、基本情况
名称:北京银行股份有限公司(简称:北京银行)
注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙 17号
法定代表人:张东宁
成立时间:1996 年1月29日
组织形式:股份有限公司(上市)
注册资本:人民币 1,520,667.5685 万元
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监许可[2008]776号
联系人:刘晔
联系电话:(010) 6622 3586

经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内结算;办理票据贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券;从事同业拆借;提供担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保管箱业务;办理地方财政信用周转使用资金的委托贷款业务;外汇存款;外汇贷款;外汇汇款;外币兑换;同业外汇拆借;国际结算;结汇、售汇;外汇票据的承兑和贴现;外汇担保;资信调查、咨询、见证业务;买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券;自营和代客外汇买卖;证券结算业务;开放式证券投资基金代销业务;债券结算代理业务;短期融资券主承销业务;经中国银行业监督管理委员会批准的其它业务。

发展概况:北京银行成立于1996年,是一家中外资本融合的新型股份制银行。成立18年来,北京银行依托中国经济腾飞崛起的大好形势,先后实现引资、上市、跨区域、综合化等战略突破。目前,已在北京、天津、上海、西安、深圳、杭州、长沙、南京、济南及南昌等10大中心城市设立300多家分支机构,发起设立北京延庆、浙江文成及吉林农安北银村镇银行,成立香港和荷兰阿姆斯特丹代表处,发起设立国内首家消费金融公司——北银消费金融公司,首批试点合资设立中荷人寿保险公司,先后设立中加基金管理公司、北银金融租赁公司,开辟和探索了中小银行创新发展的经典模式。

截至2017年末,北京银行表内外总资产突破3万亿元,其中表内资产2.33万亿元,较年初增长10.09%。全年实现净利润189亿元,同比增长5.35%;加权平均净资产收益率13.77%;营业收入504亿元,增长6.1%,其中手续费及佣金净收入106亿元,同比增长10.21%。成本收入比26.85%,人均创利近130万元,各项经营指标继续保持同业优秀水平,中小银行"领头羊"地位进一步凸显。2017年,北京银行按一级资本在全球千家大银行中排名从2004年第515位提升至目前第73位,13年上升了近500位,连续四年跻身全球百强银行之列。在世界品牌实验室品牌价值排行榜中,北京银行品牌价值从2007年39亿元增长到目前的365亿元,10年增长近10倍,排名中国银行业第7位。特别是,作为唯一金融企业,从北京市近400家企事业单位中脱颖而出,荣获第二届北京市人民政府质量管理奖,这一北京市最高质量奖项,进一步提升了品牌影响力和社会美誉度。

20年来,北京银行积极履行社会责任,在医疗、教育、慈善、赈灾等方面向社会捐助超过1亿元,充分彰显了企业社会责任。凭借优异的经营业绩和优质的金融服务,北京银行赢得了社会各界的高度赞誉,先后荣获"全国文明单位"、"亚洲十大最佳上市银行"、"中国最佳城市商业零售银行"、"最佳区域性银行"、"最佳支持中小企业贡献奖"、"最佳便民服务银行"、"中国上市公司百强企业"、"中国社会责任优秀企业"、"最具持续投资价值上市公司"、"最受尊敬银行"、"最值得百姓信赖的银行机构"及"中国优秀企业公民"等称号。

2、资产托管部主要人员情况

刘晔女士,北京银行资产托管部总经理,硕士研究生学历。1994年毕业于中国人民大学财政金融系,1997年毕业于中国人民银行总行研究生部,具有十多年银行和证券行业从业经验。曾就职于证券公司从事债券市场和股票研究工作。在北京银行工作期间,先后从事贷款审查、短期融资券承销、基金销售、资产托管等工作。2008年7月至2012年9月任北京银行资产托管部总经理助理,2012年9月至2014年12月任北京银行资产托管部副总经理。2014年12月起至今任北京银行资产托管部总经理。

北京银行总行资产托管部充分发挥作为新兴托管银行的高起点优势,搭建了由高素质人才组成的专业团队,内设核算估值岗、资金清算岗、投资运作监督岗、系统运行保障岗及风险内控岗,各岗位人员均分别具有相应的会计核算、资产估值、资金清算、投资监督、风险控制等方面的专业知识和丰富的业务经验,70%的员工拥有研究生及以上学历。

3、基金托管业务经营情况

北京银行资产托管部秉持"严谨、专业、高效"的经营理念,严格履行托管人的各项职责,切实维护基金持有人的合法权益,为基金提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,北京银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、基金专户理财、证券公司资产管理计划、信托计划、银行理财、保险资金、股权投资基金等产品在内的托管产品体系,北京银行专业高效的托管服务赢得了客户的广泛高度认同。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构
1、直销机构:
(1)天弘基金管理有限公司直销中心
住所:天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241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
法定代表人:井贤栋
电话:(022)83865560
传真:(022)83865563
联系人:司媛
客服电话:95046
(2)天弘基金管理有限公司网上直销平台
办公地址:北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 A 座 20 层
电话:(010)83571739
传真:(010)83571840
联系人:许丛立
网址:www.thfund.com.cn
(3)天弘基金管理有限公司北京分公司
办公地址:北京市西城区月坛北街2号月坛大厦A座20层
电话:(010)83571789
联系人:申向阳
(4)天弘基金管理有限公司上海分公司
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号30层E-F单元
电话:(021)50128808
联系人:张欣露
(5)天弘基金管理有限公司广州分公司
办公地址:广州市天河区珠江东路6号广州周大福金融中心16层05室
电话:(020)38927920
联系人:周波
(6)天弘基金管理有限公司深圳分公司
办公地址:深圳市福田区金田路2030号卓越世纪中心4号楼3401
电话:0755-32980136
联系人:胡珊珊
(7)天弘基金管理有限公司四川分公司
办公地址:四川省成都市高新区交子大道365号中海国际中心F座705-707号
电话:028-65159777
联系人:谭博
2、其他销售机构:
(1)北京银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:闫冰竹
联系人:韩裕
客户服务电话:95526
网址:www.bankofbeijing.com.cn
(2)中山证券有限责任公司
住所:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
办公地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
法定代表人:黄扬录
联系人:罗艺琳
客户服务电话:95329
网址:www.zszq.com.cn
(3)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法人代表:陈柏青
电话:0571-26888888
联系人:韩爱彬
客服电话:400-0766-123
网站:www.fund123.cn
(4)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法定代表人: 其实
电话:186-1170-5311
联系人: 丁姗姗
客户服务热线:400-181-8188
网址:www.1234567.com.cn
(5)深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
电话:0755-33227950
联系人:童彩平
客服电话:400-6788-887
网址:www.zlfund.cn及www.jjmmw.com
(6)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
电话:010-59601366-7024
联系人:刘静
客服电话:400-888-6661
网址:www.myfund.com
(7)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路39号第一上海中心C座6层
法人代表:梁越
电话:18641514414
联系人:张鼎
客服电话:400-898-0618
网址:www.chtfund.com
(8)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法人代表:张跃伟
电话:021-20691832
联系人:詹慧萌
客服电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com
(9)嘉实财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元
办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法人代表:赵学军
电话:010-60842306
联系人:李雯
客服电话:400-021-8850
网站:www.harvestwm.cn
(10)大泰金石基金销售有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址:南京市建邺区江东中路222号奥体中心文体创业园
法人代表:袁顾明
电话:021-22267994
联系人:赵明
客服电话:400-928-2266
网址:www.dtfunds.com
(11)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
法定代表人:王伟刚
电话:18001102931
联系人:丁向坤
客服电话:400-619-9059
网址:www.fundzone.cn
(12)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503-1504室
法定代表人:王翔
电话:17721005485
联系人:吴鸿飞
客服电话:400-820-5369
网址:www.jiyufund.com.cn
(13)深圳盈信基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1
办公地址:大连市中山区南山路155号南山1910-A3-1
法定代表人:苗宏升
联系人:王清臣
电话:13522300698
客服:4007-903-688
网址:www.fundying.com
(14)江西正融资产管理有限公司
注册地址:江西省南昌市高新区紫阳大道绿地新都会38栋2107室
办公地址:江西省南昌市高新区紫阳大道3333号绿地新都会38栋2108室
法定代表人:陆雯
联系人:傅翌乔
电话:13879129841
客服:0791-86692560
网址:www.jxzrzg.com.cn
(15)上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1栋2楼268室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:毛淮平
电话:010-88066632
联系人:仲秋玥
客服电话:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
(16)和耕传承基金销售有限公司
注册地址:郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间
办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路6号楼国际电子城b座
法定代表人:李淑慧
电话:13810222517
联系人:董亚芳
客服电话:400-360-000
网址:www.hgccpb.com
(17)通华财富(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融大厦广场杨高南路799号3号楼9楼
法定代表人:马刚
电话: 021-60810586
联系人:杨涛
客服电话: 95156
网址:www.tonghuafund.com
3、基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构调整为本基金的销售机构,并及时公告。
(二)登记机构
名称:天弘基金管理有限公司
住所:天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241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
法定代表人:井贤栋
电话:(022)83865560
传真:(022)83865563
联系人:薄贺龙
(三)律师事务所和经办律师
名称:天津嘉德恒时律师事务所
住所:天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座1009-1010
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1009-1010
法定代表人:孟卫民
电话:(022)83865255
传真:(022)83865266
经办律师:续宏帆、徐岩
联系人:续宏帆
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
经办注册会计师:薛竞、周祎
联系人:周祎

四、基金的名称

本基金名称:天弘弘利债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:债券型

六、基金的投资目标

本基金在追求本金安全的基础上,力求获得较高的当期收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)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的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

本基金采取稳健的投资策略,通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益,并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报,在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上,力争实现基金资产的持续稳定增值。

1、资产配置策略

本基金通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场研判进行前瞻性的资产配置决策。在大类资产配置上,本基金根据宏观经济运行状况、政策形势、利率走势、信用状况等的综合判断,并结合各大类资产的估值水平和风险收益特征,在基金合同规定的范围内决定各类资产的配置比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时进行动态调整。

2、债券类属配置策略

在债券等固定收益资产投资方面,本基金采取积极的主动投资管理策略,自上而下确定大类资产配置和信用债券类金融工具的类属配置比例,动态调整固定收益类证券组合久期和信用债券的结构。

3、信用债券投资策略

本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下,根据交易所市场和银行间市场等不同市场上信用债券类金融工具的到期收益率、流动性和市场规模等情况,并结合各信用债券品种之间的信用利差水平变化特征、宏观经济变化以及税收因素等的预测分析,采取定量分析和定性分析结合的方法,对各类信用债券金融工具进行优化配置。

(1)久期选择

本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势,判断债券市场的未来走势,并形成对未来市场利率变动方向的预期,动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时,适当提高组合久期,以分享债券市场上涨的收益;当预期收益率曲线上移时,适当降低组合久期,以规避债券市场下跌的风险。

(2)收益率曲线分析

本基金除考虑系统性的利率风险对收益率曲线形状的影响之外,还将考虑债券市场微观因素对收益率曲线的影响,如历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等,形成一定阶段内的收益率曲线变动趋势的预期,并适时调整基金的债券投资组合。

本基金还将通过对影响信用利差曲线的经济周期、市场供求关系和流动性变化等因素的研判,确定信用债券的行业配置和各信用级别信用债券所占的投资比 例。

(3)信用风险分析

本基金通过对信用债券发行人基本面的深入调研分析,结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果,选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

(4)信用债券品种选择

本基金根据信用债券市场收益率数据,运用利率模型对单个债券进行估值分析,并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋等因素,选择具有良好投资价值的信用债券品种进行投资。

本基金在综合分析可转换公司债券的股性特征、债性特征、流动性、摊薄率等因素的基础上,采用Black-Scholes期权定价模型和二叉树期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值,选择其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好,并且基础股票基本面优良、具有较强盈利能力、成长前景好、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种,以合理价格买入并持有,根据内含收益率、折溢价比率、久期、凸性等因素构建可转换公司债券投资组合,获取稳健的投资回报。此外,本基金将通过分析不同市场环境下可转换公司债券股性和债性的相对价值,通过对标的转债股性与债性的合理定价,力求选择被市场低估的品种,进而构建本基金可转换公司债券的投资组合。

本基金在全面分析可转换公司债券基本面的基础上,综合运用衍生工具定价模型,通过对不同市场环境下可转换公司债券的股性与债性的合理定价,选择基础股票基本面优良,具有较强赢利能力和成长前景的优质可转换债券构建组合,获取稳健的投资回报。

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,综合运用衍生工具定价模型分析评估其内在价值。

4、国债及央行票据投资策略

国债及央行票据受货币政策、利率周期、通货膨胀等宏观因素影响较大,在综合分析以上因素的基础上,本基金主要采用久期管理、跨市场套利、回购套利、收益率曲线策略等构建投资组合,力求在控制利率风险的基础上,获得较好的投资收益。

5、中小企业私募债券投资策略

在严格控制风险的前提下,通过严谨的研究,综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征,并与其他投资品种进行对比后,选择具有相对优势的类属和个券进行投资。同时,通过期限和品种的分散投资降低基金投资中小企业私募债券的信用风险、利率风险和流动性风险。

6、股票投资策略

本基金通过自下而上的公司基本面全面分析,并以前瞻性的投资视角,精选优质价值型股票进行重点投资。

(1)价值型股票初选

本基金基于宏观经济、行业趋势、公司经营以及证券市场运行的深入研究,选取市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市价现金流比(P/CF)、市价股息比(P/D)等指标,通过对上市公司各定量指标的纵向分析与横向比较,选择具有综合比较优势、价值被相对低估的上市公司股票构成价值型股票投资初选对象。

(2)公司价值动态增长分析

公司经营受到内部、外部多重因素的影响,任何因素的变化都会引起公司价值的变动,因此,科学、客观地把握公司价值的动态增长是分析并判断股票投资价值的核心。

公司价值增长以建立在核心业务基础之上的企业增长为基础,背后的驱动因素则包括商业模式、品牌和营销、市场规模与技术创新、产业政策、经营团队和公司管理水平等,并最终体现为销售收入、利润和投资本报酬率等各类绩效指标的增长。具备核心业务基础的公司需要具有四个方面的特征,即市场份额领先、盈利能力较强、具有较强的抗竞争能力和稳固的财务基础。

本基金将从运用定性与定量相结合的分析方法,考察上市公司核心业务的增长及其经营绩效,并通过对驱动公司价值增长各因素的分析与评判,考察公司价值增长的持续性。具体来说,具有以下综合优势的优质上市公司将构成本基金的重点投资对象:

1)主营业务突出,公司的业务与经营符合国家产业政策或产业升级方向;
2)产品或服务具有足够的市场容量与规模,良好的市场品牌形象,市场份额领先;
3)优秀的管理团队,清晰的公司发展战略,勇于进行管理创新,具有良好的资源获取和资源整合能力;
4)建立在核心业务基础上的技术创新、产品或服务创新、市场创新;
5)良好的盈利增长能力,财务稳健。

(3)公司基本面分析

在对上市公司进行相对价值比较和公司价值增长趋势分析的过程中,全面的公司基本面分析将贯穿其中。

公司基本面分析的主要内容包括价值评估、成长性评估、现金流预测和行业环境评估等。基本面分析的目的是从定性和定量两个方面考量行业竞争趋势、短期和长期内公司现金流增长的主要驱动因素,业务发展的关键点等,进而做出明确的公司评价和投资建议。

7、权证投资策略

本基金通过对权证标的证券基本面的研究,采取市场公认的权证定价模型寻求其合理的价格水平,作为基金投资权证的主要依据。

(二)投资决策流程

1、决策依据
(1)国家有关法律、法规和《基金合同》的规定;
(2)以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则;
(3)国内宏观经济发展态势、微观经济运行环境、证券市场走势、政策指向及全球经济因素分析。

2、投资管理程序

(1)备选库的形成与维护

对于债券投资,分析师通过宏观经济、货币政策和债券市场的分析判断,采用利率模型、信用风险模型及期权调整利差(OAS)对普通债券和含权债券进行分析,在此基础上形成基金债券投资的信用债备选库。

对于股票投资,分析师根据各个行业及个股的投资评级,确定股票初选库,在此基础上,通过对上市公司基本面的全面考察,筛选出优质上市公司股票,并经投研会议审议批准后,进入股票投资备选库,分析师将对备选库的股票进行跟踪分析,并及时提出调整建议。

(2)资产配置会议

本基金管理人定期召开资产配置会议,讨论基金的资产组合以及个股配置,形成资产配置建议。

(3)构建投资组合

投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下,审议并确定基金资产配置方案,并审批重大单项投资决定。

基金经理在投资决策委员会的授权下,根据本基金的资产配置要求,参考资产配置会议、投研会议讨论结果,制定基金的投资策略,在其权限范围进行基金的日常投资组合管理工作。

(4)交易执行

基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室发出交易指令。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作,并将指令的执行情况反馈给基金经理。

(5)投资组合监控与调整

基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况,风险管理部与监察稽核部对基金投资进行日常监督,风险管理分析师负责完成内部的基金业绩和风险评估。基金经理定期对证券市场变化和基金投资阶段成果和经验进行总结评估,对基金投资组合不断进行调整和优化。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后)+1.5%

三年期银行定期存款利率指同期中国人民银行网站上发布的三年期 "金融机构人民币存款基准利率"。以上业绩基准符合本基金的产品定位,且易于投资者理解和接受,适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时,基金管理人和基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,可以变更本基金业绩比较基准并及时公告。

十、风险收益特征

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证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责任。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年9月29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、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

以下内容摘自本基金2018年度第2季度报告:

1、报告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	权益投资	17,651,847.88	5.02
	其中:股票	17,651,847.88	5.02
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	257,973,191.10	73.35
	其中:债券	257,973,191.10	73.35
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	4,117,252.90	1.17
8	其他资产	71,974,858.03	20.46
9	合计	351,717,149.91	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	7,831,613.09	2.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,362,560.98	3.18
J	金融业	1,457,673.81	0.55
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	17,651,847.88	6.70

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300523	辰安科技	79,480	4,950,014.40	1.88
2	002410	广联达	99,346	2,754,864.58	1.05
3	002370	亚太药业	200,800	2,726,864.00	1.04
4	603707	健友股份	95,293	2,585,299.09	0.98
5	603589	口子窖	41,000	2,519,450.00	0.96
6	601688	华泰证券	97,373	1,457,673.81	0.55
7	300059	东方财富	49,900	657,682.00	0.25

4、报告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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	94,415,800.00	35.85
	其中:政策性金融债	94,415,800.00	35.85
4	企业债券	70,832,391.10	26.89
5	企业短期融资券	40,279,000.00	15.29
6	中期票据	50,012,000.00	18.99
7	可转债(可交换债)	2,434,000.00	0.92
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	257,973,191.10	97.95

注:可转债项下包含可交换债2,434,000.00元。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180205	18国开05	700,000	73,409,000.00	27.87
2	041772015	17环球租赁CP002	200,000	20,150,000.00	7.65
3	101654080	16船重MTN001	200,000	19,754,000.00	7.50
4	136529	16中车G3	200,000	19,672,000.00	7.47
5	136629	16兵装01	200,000	19,608,000.00	7.45

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1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。

11.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

11.3 其他资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	441,696.28
2	应收证券清算款	65,435,208.77
3	应收股利	—
4	应收利息	6,097,952.98
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	71,974,858.03

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

11.6 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。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日2013年9月11日,基金业绩数据截止至2018年06月30日。

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	净值收益率①	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
2013/9/11-2013/12/31	1.20%	0.05%	1.79%	0.02%	-0.59%	0.03%
2014/1/1-2014/12/31	10.87%	0.16%	5.70%	0.02%	5.17%	0.14%
2015/1/1-2015/12/31	13.37%	0.11%	4.59%	0.01%	8.78%	0.10%
2016/1/1-2016/12/31	-1.02%	0.15%	3.84%	0.01%	-4.86%	0.14%
2017/1/1-2017/12/31	2.58%	0.10%	3.69%	0.01%	-1.11%	0.09%
2018/1/1-2018/6/30	0.85%	0.23%	1.76%	0.01%	-0.91%	0.22%
自基金合同生效日(2013/09/11-2018/6/30)	30.25%	0.14%	23.29%	0.01%	6.96%	0.13%

十三、基金费用与税收

(一)基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、证券账户开户费用、银行账户维护费;
9、中债曲线与估值服务费;
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.4%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.4%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.1%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述"一、基金费用的种类中第3-9项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《流动性管理规定》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金管理人于2018年04月24日公告的《天弘弘利债券型证券投资基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:

1、更新了"重要提示"中相关内容;
2、更新了"三、基金管理人"中相关内容;
3、更新了"四、基金托管人"中相关内容;
4、更新了"五、相关服务机构"中相关内容;
5、更新了"十、基金投资组合报告"相关内容,该部分内容均按有关规定编制,并经托管人复核;
6、更新了"十一、基金的业绩"的相关内容,该部分内容均按有关规定编制,并经托管人复核;
7、更新了"二十三、其他应披露的事项",披露了自上次内容更新截止日至本次内容更新截止日期间涉及本基金及基金管理人的相关公告。

天弘基金管理有限公司
二〇一八年十月二十五日

天弘基金管理有限公司关于增加东方证券股份有限公司为天弘添利债券型证券投资基金(LOF)销售机构并开通申购、赎回业务的公告

根据天弘基金管理有限公司(以下简称"本公司")与东方证券股份有限公司(以下简称"东方证券")签署的相关基金销售服务协议,自2018年10月25日起,本公司增加东方证券为天弘添利债券型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")的销售机构并开通申购、赎回业务。详情如下:

一、适用的投资者范围

通过东方证券指定平台申购、赎回本基金且符合基金合同约定的投资者。

二、适用的基金范围

基金名称	基金代码	是否开通申购、赎回
天弘添利债券型证券投资基金(LOF)	164206	是

三、重要提示

1、投资者欲了解本基金的详细情况,请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

2、上述相关业务办理规则的具体内容请以东方证券的规定、公告或通知为准。

投资者可以通过以下途径咨询有关情况:
(1)天弘基金管理有限公司
客服热线:95046
网站:www.thfund.com.cn
(2)东方证券股份有限公司
客服热线:95503
网站:www.dfzq.com.cn

风险提示:本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。投资者投资本公司管理的基金时,应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件,并注意投资风险。

特此公告。

天弘基金管理有限公司
二〇一八年十月二十五日