

天弘弘利债券型证券投资基金

[2014]第三季度报告

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
报告送出日期:2014年10月24日

5.1 重要提示

在由政策放松带来的乐观情绪中,信用利差继续收窄,信用品收益率曲线也随之基本面趋势变化下行。本基金在报告期内,规模略有增加,投资策略以杠杆为主,充分获得了政策调整带来的收益。

本基金管理人声明本公司根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》,于2014年10月24日复核了本基金中的财务指标,净值表现和投资组合报告,保证不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金管理人承诺诚实守信、勤勉尽责,但不保证本基金一定盈利。

本基金的财务资料未经审计。

本公司自2014年7月1日起至2014年9月30日止,对本基金的财务资料进行了复核。

本公司自2014年7月1日起至2014年9月30日止,对本基金的财务资料进行了复核。

5.2 基金产品概况

基金简称 天弘弘利债券

基金代码 000306

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年9月11日

报告期末基金份额总额 360,552,620份

5.3 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7月1日-2014年9月30日)

1.本期已实现收益 6,297,813.55

2.本期利润 12,846,685.96

3.加权平均基金份额本期利润 0.0382

4.期末基金资产净值 393,035,687.72

5.期末基金份额净值 1.090

注:1.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。

2.所列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将低于此数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长 率 净值增 长率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 长率 净值增 长率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 长率 净值增 长率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 长率 净值增 长率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 长率 净值增 长率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 长率 净值增 长率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 长率 净值增 长率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 长率 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 长率 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以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

阶段 净值增 镀金率标 准差 标准差比 例 ① ② ③ ④

过去二个月 3.61% 0.07% 1.46% 0.01% 2.21% 0.06%

百利基金同生效以来以基金份额累计