天弘永利债券型证券投资基金 2016年年度报告摘要

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
送出日期:2017年03月30日

§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2017年3月28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2016年1月1日起至2016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04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	2,586,631,828.66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	天弘永利债券E
下属分级基金的交易代码	420002	420102	002794
报告期末下属分级基金的份额总额	663,613,310.80份	1,780,649,316.53份	142,369,201.33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,围绕券、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	中债新综合指数
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		4007109999	95561
传真		022-83695669	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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	天弘永利债券A		
	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	45,037,449.47	90,707,215.28	42,204,382.07
本期利润	21,894,116.09	137,697,098.50	53,534,206.62
加权平均基金份额本期利润	0.0261	0.1410	0.0831
本期基金份额净值增长率	2.63%	15.19%	9.68%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0049	0.0046	-0.0037
期末基金资产净值	713,297,479.08	1,055,231,351.64	1,186,077,783.07
期末基金份额净值	1.0749	1.1012	1.0433

3.1.3 期间数据和指标	天弘永利债券B		
	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	121,119,221.93	113,901,540.25	10,667,501.42
本期利润	62,249,531.49	177,845,654.32	20,894,619.54
加权平均基金份额本期利润	0.0302	0.1198	0.0916
本期基金份额净值增长率	2.99%	15.50%	10.17%
3.1.4 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0055	0.0052	-0.0034
期末基金资产净值	1,915,785,560.87	2,434,364,309.15	295,722,385.38
期末基金份额净值	1.0759	1.1022	1.0440

3.1.5 期间数据和指标	天弘永利债券E		
	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	2,181,539.70	-	-
本期利润	695,072.85	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0128	-	-
本期基金份额净值增长率	-5.47%	-	-
3.1.6 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0547	-	-
期末基金资产净值	134,585,258.43	-	-
期末基金份额净值	0.9453	-	-

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、本基金于2016年5月10日起增加天弘永利债券E类基金份额。

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(天弘永利债券A)	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	-0.77%	0.11%	-1.50%	0.15%	0.73%	-0.04%
过去六个月	1.17%	0.09%	0.24%	0.11%	0.93%	-0.02%
过去一年	2.63%	0.09%	1.83%	0.09%	0.80%	0.00%
过去三年	29.66%	0.16%	18.65%	0.11%	11.01%	0.05%
过去五年	41.46%	0.14%	25.63%	0.09%	15.83%	0.05%
自基金合同生效日起至今(2008年04月18日-2016年12月31日)	58.27%	0.16%	43.33%	0.09%	14.94%	0.07%

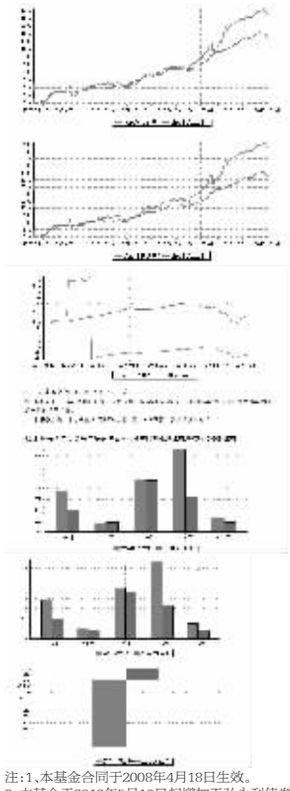
阶段(天弘永利债券B)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.67%	0.11%	-1.50%	0.15%	0.83%	-0.04%
过去六个月	1.36%	0.09%	0.24%	0.11%	1.12%	-0.02%
过去一年	2.99%	0.09%	1.83%	0.09%	1.16%	0.00%
过去三年	31.06%	0.16%	18.65%	0.11%	12.41%	0.05%
过去五年	44.28%	0.14%	25.63%	0.09%	18.65%	0.05%
自基金合同生效日起至今(2008年04月18日-2016年12月31日)	63.98%	0.16%	43.33%	0.09%	20.65%	0.07%

阶段(天弘永利债券E)	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	-0.71%	0.11%	-1.50%	0.15%	0.79%	-0.04%
过去六个月	-11.54%	1.13%	0.24%	0.11%	-11.78%	1.02%
自基金合同生效日起至今(2008年04月18日-2016年12月31日)	-5.47%	1.08%	0.93%	0.10%	-6.40%	0.98%

注:1.自基金合同生效日至2015年9月30日本基金业绩比较基准为:中信标普全债指数,2015年10月1日开始变更为:中债新综合指数。中债新综合指数隶属于中债总指数族分类,该指数成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有公开发行的可流通债券,是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数,由于样本债券涵盖的范围广,中债新综合指数可以作为具备一般性的业绩比较基准。

2. 本基金于2016年5月10日起增加天弘永利债券E类基金份额。

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:1、本基金合同于2008年4月18日生效。

2、本基金于2016年5月10日起增加天弘永利债券E类基金份额,并于2016年5月12日起办理该类份额的申购和赎回业务。天弘永利债券E类2016年的净值增长率按照天弘永利债券E类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

单位:人民币元

年度(天弘永利债券A)	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
2016年	0.552	36,105,979.72	14,480,313.26	50,586,292.98	无
2015年	0.976	69,843,390.80	15,523,404.21	85,366,795.01	无
2014年	0.406	18,385,547.02	6,563,960.83	24,949,507.85	无
合计	1.934	124,334,917.54	36,567,678.30	160,902,595.84	无
年度(天弘永利债券B)	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
2016年	0.591	116,721,844.99	7,593,398.63	124,315,243.62	无
2015年	1.004	192,563,391.13	10,486,454.75	203,049,845.88	无
2014年	0.463	10,907,710.31	632,884.65	11,540,594.96	无
合计	2.058	320,192,946.43	18,712,738.03	338,905,684.46	无

注:天弘永利债券型证券投资基金E类基金份额不符合分红条件,故本报告期内未进行收益分配。

§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"本基金管理人")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5.143亿元人民币,总部设在天津,在北京、上海、广州、天津设有分公司。公司股权结构为:

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%

截至2016年12月31日,本基金管理人共管理53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、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金(LOF)、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)、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、天弘余额宝货币市场基金、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、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金(LOF)、天弘瑞利分级债券型证券投资基金、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数型发起式证券投资基金、天弘增益宝货币市场基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证100指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘乐享保本混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金。

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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜晓丽	本基金基金经理。	2012年08月	-	7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、基金经理助理等。

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

2016年,经济基本面呈现企稳改善态势,前期货币宽松累积效应显现,名义GDP增速触底回升,通缩改善带动企业收入及利润改善,下游地产汽车也成为需求亮点。通胀方面,CPI整体平稳,但是PPI方面由于基数效应及大宗商品表现强势,同比增速出现快速反弹。政策面方面,货币政策真正转向稳健中性。全年央行仅于2月末降准一次,主要通过OMO和MLF相结合的方式来提供基础货币。资金面方面,前三季度资金中枢在波动中维持稳定,但四季度资金利率中枢快速上行,波动明显加大。央行通过权长提供资金期限以拍升资金成本中枢,同时央行对资金利率波动率容忍程度也明显提高,因此导致四季度资金利率波动率和中枢均较前三季度明显上升。债市方面,前三季度整体震荡中上涨,市场在乐观心态中消灭各种利差,进入四季度,多种因素之下,市场出现快速巨幅调整。

本基金在报告期内,整体维持低杠杆短久期的谨慎态度,同时在严控股票仓位的情况下参与权益市场机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,永利A基金份额净值为1.0749元,永利B基金份额净值为1.0759元,永利E基金份额净值为0.9453。本报告期内份额净值增长率永利A为2.63%,永利B为2.99%,同期业绩比较基准增长率为1.83%;永利E为-5.47%,同期业绩比较基准增长率为0.93%。

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2017年,基本面大概率呈现前高后低,我们认为未来经济仍然面临下行压力,但经济下行的速度和幅度会低于市场预期。资金面方面,脉冲式收紧仍将出现,资金利率中枢趋势性抬升,资金利率波动性加大。政策面方面,货币政策边际趋紧,以配合防范金融风险和抑制资产泡沫。

对于债券市场未来的看法,我们认为债市整体杠杆仍然较高,去杠杆压力巨大。利率债在前期的大幅下跌中,风险释放较为充分;信用债收益率整体过低,风险较大,将在未来的去杠杆过程中收益率持续上行。我们对于市场出现机会的时点判断会进一步延后,利率债可以更早考虑价值的出现。投资策略上,本基金将保持债券投资低久期低仓位的防守配置,等待市场出清后的机会;会适度参与股票的投资机会。

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固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

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、基金会计、风险管理人员及监察稽核人员组成。

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人和会计师事务所。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2016年2月19日已实现的可分配收益36,695,090.69元为基准计算,2016年3月4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0.105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0.115元;以2016年4月29日已实现的可分配收益21,659,566.64元为基准计算,2016年5月12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0.068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0.075元;以2016年9月2日已实现的可分配收益70,818,059.62元为基准计算,2016年9月19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0.224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0.238元;以2016年11月18日已实现的可分配收益 55,968,796.83元为基准计算,2016年11月30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0.155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0.163元。四次分红均符合本基金基金合同中利润分配的相关约定。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§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(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:天弘永利债券型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	17,540,496.37	67,168,935.51
结算备付金		20,215,635.47	13,958,498.05
存出保证金		1,027,059.11	141,647.27
交易性金融资产	7.4.7.2	2,429,853,427.60	4,661,514,633.72
其中:股票投资		104,258,827.90	93,456,352.02
基金投资		-	-
债券投资		2,325,594,599.70	4,568,058,281.70
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	304,938,342.41	-
应收证券清算款		7,000,000.00	-
应收利息	7.4.7.5	39,253,076.14	79,657,367.92
应收股利		-	-
应收申购款		35,676,282.46	17,209,829.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,855,504,319.56	4,839,650,911.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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		67,000,000.00	1,279,098,144.50
应付证券清算款		16,134,706.49	11,800,277.30
应付赎回款		3,296,039.17	54,022,864.28
应付管理人报酬		1,825,472.64	2,334,831.23
应付托管费		521,563.63	667,094.64
应付销售服务费		273,164.50	406,508.76
应付交易费用	7.4.7.7	1,431,765.39	104,194.00
应交税费		814,404.89	814,404.89
应付利息		23,485.48	204,253.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	515,418.99	602,677.20
负债合计		91,836,021.18	1,350,055,250.70
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,586,631,828.66	3,166,868,344.68
未分配利润	7.4.7.10	177,036,469.72	322,727,316.11
所有者权益合计		2,763,668,298.38	3,489,595,660.79
负债和所有者权益总计		2,855,504,319.56	4,839,650,911.49

注:报告截止日2016年12月31日,天弘永利债券型证券投资基金A类基金份额净值1.0749元,天弘永利债券型证券投资基金B类基金份额净值1.0759元,天弘永利债券型证券投资基金E类基金份额净值0.9453元;基金份额总额2,586,631,828.66份,其中天弘永利债券型证券投资基金A类基金份额663,613,310.80份,天弘永利债券型证券投资基金B类基金份额1,780,649,316.53份,天弘永利债券型证券投资基金E类基金份额142,369,201.33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:2016年01月01日至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2016年01月01日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年01月01日至2015年12月31日
一、收入		133,487,399.80	366,368,598.62
1.利息收入		164,829,681.51	171,122,855.75
其中:存款利息收入	7.4.7.11	1,336,933.48	1,831,044.48
债券利息收入		159,820,578.71	168,513,333.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,672,173.32	778,477.75
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		51,028,322.08	82,617,165.49
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-4,763,267.32	36,304,248.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	53,930,546.07	46,212,951.76
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,861,043.33	99,965.39
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-83,589,490.67	110,933,997.29
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	1,218,882.88	1,694,580.09
减:二、费用		48,738,679.37	50,825,845.80
1. 管理人报酬		22,602,952.23	19,021,396.80
2. 托管费		6,457,986.36	5,434,684.41
3. 销售服务费		3,701,646.61	4,321,809.83
4. 交易费用	7.4.7.19	5,023,224.49	1,431,871.37
5. 利息支出		10,457,101.71	20,132,460.43
其中:卖出回购金融资产支出		10,457,101.71	20,132,460.43
6. 其他费用	7.4.7.20	495,767.97	483,623.96
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		84,748,720.43	315,542,752.82
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		84,748,720.43	315,542,752.82

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:2016年01月01日至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2016年01月01日至2016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)	3,166,868,344.68	322,727,316.11	3,489,595,660.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	84,748,720.43	84,748,720.43
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)	-580,236,516.02	-65,538,030.22	-645,774,546.24
其中:1.基金申购款	4,557,759,637.02	353,983,237.93	4,911,747,874.95
2.基金赎回款	-5,137,996,153.04	-409,526,268.15	-5,547,522,421.19
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)	-	-174,901,536.60	-174,901,536.60
五、期末所有者权益(基金净值)	2,586,631,828.66	177,036,469.72	2,763,668,298.38
项 目	上年度可比期间2015年01月01日至2015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)	1,420,092,845.55	61,707,322.90	1,481,800,168.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	315,542,752.82	315,542,752.82
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)	1,746,775,499.13	233,893,881.28	1,980,669,380.41
其中:1.基金申购款	8,437,356,751.29	874,692,606.38	9,312,049,357.67
2.基金赎回款	-6,690,581,252.16	-640,798,725.10	-7,331,379,977.26
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)	-	-288,416,640.89	-288,416,640.89
五、期末所有者权益(基金净值)	3,166,868,344.68	322,727,316.11	3,489,595,660.79

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	薄贤龙
基金管理人负责人	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 基金基本情况

天弘永利债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2008]第237号《关于核准天弘永利债券型证券投资基金设立的批复》核准,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘永利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币684,977,572.50元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第044号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘永利债券型证券投资基金基金合同》于2008年4月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为685,027,307.52份基金份额,其中认购资金利息折合49,735.02份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《天弘永利债券型证券投资基金基金合同》和《天弘永利债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金自募集期起根据认购/申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。不收取认购/申购费用的,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为天弘永利债券型证券投资基金A类(以下简称"A类基金");收取认购/申购费用的,且不再从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为天弘永利债券型证券投资基金B类(以下简称"B类基金")。本基金A类和B类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额及B类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据基金管理人天弘基金管理有限公司2016年5月10日《关于天弘永利债券型证券投资基金增设E类份额并相应修订基金合同部分条款的公告》的规定,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自2016年5月10日起对本基金增加天弘永利债券型证券投资基金E类(以下简称"E类基金")并相应修改基金合同。E类基金份额与B类基金份额相关费率相同,即收取认购/申购费用,但不再从本类别基金资产中计提销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘永利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为固定收益类证券,包括国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转债(可分离交易可转债)、资产支持证券、央行票据、短期融资券、回购等固定收益证券品种,及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。为提高基金收益水平,本基金可以参与新股申购及二级市场股票投资。本基金对债券类资产及中国证监会批准的允许基金投资的其他固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的80%,对股票等权益类证券的投资比例不超过基金资产的20%,对现金和到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。自基金合同生效日至2015年9月30日,本基金的业绩比较基准为:中信标普全债指数。根据本基金的基金管理人于2015年9月24日发布的《天弘基金管理有限公司关于变更天弘永利债券型证券投资基金业