

天弘永利债券型证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30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
报告送出日期:2009年8月25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法律责任。本半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约定,于2009年8月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配方案、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,基金的投资业绩不代其未来表现,投资者有风险,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。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应请阅读半年度报告正文。
本报告中财务资料未经审计。
本报告日期:2009年1月1日起至2009年6月30日止。

基金名称	天弘永利债券
交易代码	420002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2008年4月18日
报告期末基金份额总额	101,754,871.33份
前期末基金份额总额	天弘永利债券 A 天弘永利债券 B
前期末基金份额总额	420002 420102
前期末基金份额总额	73,130,057.24份 28,624,814.09份

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提供较高的投资回报。
投资策略	本基金通过宏观、中观、微观三个层面的分析,对宏观经济运行状况、货币政策和财政政策的变化、利率走势、通货膨胀、企业盈利和估值等因素进行研判,从而确定整体资产配置策略、债券配置、基金仓位调整策略等。本基金的投资策略将以分散化投资为主,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。
业绩比较基准	中债综合债券指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中风险较低的产品,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。

项目	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
名称	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
姓名	吕伟江	基金托管人	张忠志
联系电话	022-83865568	基金托管人	021-62677777 212004
电子邮箱	hr@thfund.com.cn	基金托管人	zhangydw@ccb.com.cn
客户服务电话	022-83119988 4007109999	基金托管人	95561
传真	022-83865569	基金托管人	021-62199217

基金半年度报告正文的披露网站	www.thfund.com.cn
基金半年度报告各备地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标和基金净值表现

本期已实现收益	3,129,366.51
本期利润	8,963.62
加权平均基金份额本期利润	0.0002
本期基金份额净值增长率	0.17%

期末可供分配基金份额总额	80,009
期末基金资产净值	73,342,303.29
期末基金份额净值	1.0029

3.1.1.1 期间数据和指标	2009年1月1日至2009年6月30日
本期已实现收益	6,160,807.40
本期利润	-133,041.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0013
本期基金份额净值增长率	-0.07%

3.1.1.1 期间数据和指标	2009年1月1日至2009年6月30日
本期已实现收益	3,129,366.51
本期利润	8,963.62
加权平均基金份额本期利润	0.0002
本期基金份额净值增长率	0.17%

3.1.1.2 期末数据和指标	2009年1月1日至2009年6月30日
期末可供分配基金份额总额	0.0031
期末基金资产净值	28,713,193.76
期末基金份额净值	1.0031

3.1.1.2 期末数据和指标	2009年1月1日至2009年6月30日
本期已实现收益	3,129,366.51
本期利润	8,963.62
加权平均基金份额本期利润	0.0002
本期基金份额净值增长率	0.17%

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
过去一个月	0.38%	0.18%	-0.10%	0.03%	0.48%	0.15%
过去三个月	0.05%	0.14%	0.42%	0.05%	-0.37%	0.09%
过去六个月	-0.07%	0.15%	0.42%	0.08%	-0.49%	0.07%
过去一年	6.65%	0.19%	7.92%	0.11%	1.27%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.9%	0.17%	7.96%	0.10%	-0.67%	0.07%

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
过去一个月	0.42%	0.18%	-0.10%	0.03%	0.52%	0.15%
过去三个月	0.15%	0.14%	0.42%	0.05%	-0.27%	0.09%
过去六个月	0.17%	0.15%	0.42%	0.08%	-0.25%	0.07%
过去一年	7.15%	0.19%	7.92%	0.11%	-0.77%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.88%	0.17%	7.96%	0.10%	-0.78%	0.07%

注:1.上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损益。
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.38%	0.18%	-0.10%	0.03%	0.48%	0.15%
过去三个月	0.05%	0.14%	0.42%	0.05%	-0.37%	0.09%
过去六个月	-0.07%	0.15%	0.42%	0.08%	-0.49%	0.07%
过去一年	6.65%	0.19%	7.92%	0.11%	1.27%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.9%	0.17%	7.96%	0.10%	-0.67%	0.07%

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
过去一个月	0.42%	0.18%	-0.10%	0.03%	0.52%	0.15%
过去三个月	0.15%	0.14%	0.42%	0.05%	-0.27%	0.09%
过去六个月	0.17%	0.15%	0.42%	0.08%	-0.25%	0.07%
过去一年	7.15%	0.19%	7.92%	0.11%	-0.77%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.88%	0.17%	7.96%	0.10%	-0.78%	0.07%

注:1.上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损益。
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.38%	0.18%	-0.10%	0.03%	0.48%	0.15%
过去三个月	0.05%	0.14%	0.42%	0.05%	-0.37%	0.09%
过去六个月	-0.07%	0.15%	0.42%	0.08%	-0.49%	0.07%
过去一年	6.65%	0.19%	7.92%	0.11%	1.27%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.9%	0.17%	7.96%	0.10%	-0.67%	0.07%

注:1.上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损益。
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.42%	0.18%	-0.10%	0.03%	0.52%	0.15%
过去三个月	0.15%	0.14%	0.42%	0.05%	-0.27%	0.09%
过去六个月	0.17%	0.15%	0.42%	0.08%	-0.25%	0.07%
过去一年	7.15%	0.19%	7.92%	0.11%	-0.77%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.88%	0.17%	7.96%	0.10%	-0.78%	0.07%

注:1.上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损益。
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.38%	0.18%	-0.10%	0.03%	0.48%	0.15%
过去三个月	0.05%	0.14%	0.42%	0.05%	-0.37%	0.09%
过去六个月	-0.07%	0.15%	0.42%	0.08%	-0.49%	0.07%
过去一年	6.65%	0.19%	7.92%	0.11%	1.27%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.9%	0.17%	7.96%	0.10%	-0.67%	0.07%

注:1.上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损益。
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.42%	0.18%	-0.10%	0.03%	0.52%	0.15%
过去三个月	0.15%	0.14%	0.42%	0.05%	-0.27%	0.09%
过去六个月	0.17%	0.15%	0.42%	0.08%	-0.25%	0.07%
过去一年	7.15%	0.19%	7.92%	0.11%	-0.77%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.88%	0.17%	7.96%	0.10%	-0.78%	0.07%

注:1.上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损益。
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.38%	0.18%	-0.10%	0.03%	0.48%	0.15%
过去三个月	0.05%	0.14%	0.42%	0.05%	-0.37%	0.09%
过去六个月	-0.07%	0.15%	0.42%	0.08%	-0.49%	0.07%
过去一年	6.65%	0.19%	7.92%	0.11%	1.27%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.9%	0.17%	7.96%	0.10%	-0.67%	0.07%

注:1.上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损益。
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.42%	0.18%	-0.10%	0.03%	0.52%	0.15%
过去三个月	0.15%	0.14%	0.42%	0.05%	-0.27%	0.09%
过去六个月	0.17%	0.15%	0.42%	0.08%	-0.25%	0.07%
过去一年	7.15%	0.19%	7.92%	0.11%	-0.77%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.88%	0.17%	7.96%	0.10%	-0.78%	0.07%

注:1.上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损益。
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.38%	0.18%	-0.10%	0.03%	0.48%	0.15%
过去三个月	0.05%	0.14%	0.42%	0.05%	-0.37%	0.09%
过去六个月	-0.07%	0.15%	0.42%	0.08%	-0.49%	0.07%
过去一年	6.65%	0.19%	7.92%	0.11%	1.27%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.9%	0.17%	7.96%	0.10%	-0.67%	0.07%

注:1.上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损益。
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.42%	0.18%	-0.10%	0.03%	0.52%	0.15%
过去三个月	0.15%	0.14%	0.42%	0.05%	-0.27%	0.09%
过去六个月	0.17%	0.15%	0.42%	0.08%	-0.25%	0.07%
过去一年	7.15%	0.19%	7.92%	0.11%	-0.77%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.88%	0.17%	7.96%	0.10%	-0.78%	0.07%

注:1.上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损益。
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.38%	0.18%	-0.10%	0.03%	0.48%	0.15%
过去三个月	0.05%	0.14%	0.42%	0.05%	-0.37%	0.09%
过去六个月	-0.07%	0.15%	0.42%	0.08%	-0.49%	0.07%
过去一年	6.65%	0.19%	7.92%	0.11%	1.27%	0.08%
自基金合同生效起至今	7.9%	0.17%	7.96%	0.10%	-0.67%	0.07%

本报告期末,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 管理人及报告期内本基金管理人履行职责的情况
4.3.1 公平交易制度的执行情况
基金管理人一直将公平对待旗下所有基金的原则,在投资决策及执行各个环节保证公平交易原则的严格执行。根据《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》的要求,公司制定并执行了公平交易管理办法,公平交易管理办法的范围包括各投资组合、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活动。
公平交易的执行情况包括:公平对待不同投资组合,严禁以任何方式进行利益输送,在投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等方面严格执行公平交易制度,在保障各投资组合投资权限的前提下,严格执行投资授权程序,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;实行集中交易制度和交易分配机制,确保对投资行为的有效监控和约束。
4.3.2 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.3 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.4 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.5 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.6 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.7 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.8 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.9 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.10 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.11 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.12 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.13 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.14 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.15 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.16 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.17 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.18 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.19 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.20 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.21 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.22 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.23 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.24 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.25 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.26 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.27 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.28 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.29 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.30 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.3.31 本基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。
4.