天弘永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：兴业银行股份有限公司
日　　期：二〇一二年六月

重要提示

天弘永利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2008年2月14日经中国证监会证监许可［2008］237号文核准募集。本基金的基金合同于2008年4月18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。

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。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。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，并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投资者的风险承受能力相适应。

投资者应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的不同。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

天弘永利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由天弘基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依照有关法律法规及约定发起，并经中国证券监督管理委员会证监许可［2008］237号文核准。本基金的《基金合同》和《招募说明书》已通过证券时报和基金管理人的互联网网站（www.tffund.com.cn）进行了公开披露。但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。

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。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者基金投资的“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引致的投资风险，由投资者自行负担。

投资者应当通过基金管理人或具有基金代销业务资格的其他机构购买和赎回基金，基金代销机构名单详见本基金《招募说明书》以及相关公告。

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2012年4月18日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年3月31日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

机构名称：天弘基金管理有限公司
成立日期：2004年11月8日
注册地址：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
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：李琦
电话：022-83310208
传真：022-83865563
联系人：吕传红
组织形式：有限责任公司
注册资本：人民币1.8亿元
邮政编码：300203

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字［2004］164号文批准于2004年11月8日成立，注册资本金为人民币1.8亿元。公司股东为天津信托有限责任公司（持股比例48%），内蒙古君正能源化工股份有限公司（持股比例36%）、苏州高新投资有限公司（持股比例16%）。

截至2012年4月18日，公司旗下管理的基金有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、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、天弘周期策略股票型证券投资基金、天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）、天弘添利分级债券型证券投资基金、天弘丰利分级债券型证券投资基金。

公司下设股票投资部、固定收益部、中央交易室、市场部、渠道部、电子商务部、客户服务部、机构理财部、风险管理部、监察稽核部、信息技术部、基金运营部、财务部、综合管理部和人力资源部，成立了北京分公司、上海分公司、广州分公司。随着公司业务发展的需要，将对业务部门及分支机构进行适当的调整。

基金管理人无任何处罚记录。

（二）主要人员情况介绍

1、董事会成员基本情况：

李琦先生，董事长，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。现任天津信托有限责任公司副总经理。

卢信群先生，副董事长，大学本科。历任北京华仪软件系统工程公司技术经理，北京金田电脑经营公司技术经理，联想科技技术经理，香港荣基科技有限公司部门经理，北京君正投资管理顾问有限公司部门经理。现任内蒙古君正能源化工股份有限公司副总经理兼财务总监。

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。

李腊水先生，独立董事，硕士研究生。历任福州军区军政干部学校教官、解放军军事交通学院教官、天津市体改委处长、副主任、天津市发改委副主任、天津国际工程咨询公司总经理。现任天津市工程咨询协会会长、天津市房地产发展（集团）股份有限公司独立董事、天津天保基建股份有限公司独立董事、天津海泰科技发展股份有限公司独立董事、天津天海汽车同步器有限公司独立董事、天津应大股份有限公司独立董事、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、天津市仲裁委员会仲裁员、天津财经大学客座教授。

田军先生，独立董事，博士研究生。历任中国人民解放军6410工厂宣传干事，国家物价局处长，伦敦经济学院国际经济研究中心研究员，中国经济学会（英国）主席秘书长，英国Crasby-MTM公司副总裁，英国富地石油轮胎公司副总裁。现任富地燃气投资有限公司总裁。

王国华先生，独立董事，博士研究生。历任中央财经大学税务学院教授、博士生导师、中国银河证券股份有限公司副总经理，现任银河创新资本管理有限公司董事长、总经理、四川丹甫制冷压缩机股份有限公司独立董事、北京佳讯飞鸿股份有限公司独立董事、中央财经大学兼职教授、博士生导师。

付岩先生，董事，大学本科。历任北洋（天津）煤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，天津顺驰投资集团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自营业务部项目经理。

2、监事会成员基本情况：

苏钢先生，监事会主席，大学本科。历任职于博弘国际投资控股有限公司，乌海市海神热电有限责任公司。现任内蒙古君正能源化工股份有限公司董事，北京博晖创新光电技术股份有限公司副董事长。

宁辰先生，监事，硕士研究生。历任亚洲证券天津勤俭道营业部营销总监，本公司市场部总经理。现任本公司总经理助理。

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，本公司信息技术部总经理。现任本公司信息技术总监兼信息技术部总经理。

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。

吕传红先生，督察长，硕士研究生。历任湖北省荆门市沙洋区人民检察院助理检察员、检察员，湖北省贸易厅纪检监察员，南开大学法学院讲师，天津开元律师事务所兼职律师，中国证券监督管理委员会天津监管局干部，中国证券监督管理委员会公职律师。

4、本基金基金经理

陈钢先生，工商管理硕士，10年证券从业经验，历任华龙证券公司固定收益部高级经理、北京富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月加盟本公司，现任固定收益总监兼固定收益部总经理、天弘永利债券型证券投资基金基金经理、天弘添利分级债券型证券投资基金基金经理、天弘丰利分级债券型证券投资基金基金经理。

历任基金经理：蔡宾女士，任职期间：2008年4月至2008年5月。

裴方女士，任职期间：2008年4月至2009年6月。

姚锦女士，任职期间：2009年3月至2011年3月。

朱虹女士，任职期间：2010年5月至2011年12月。

5、基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

郭树强先生，董事、总经理，投资决策委员会主席兼投资总监；周可彦先生，股票投资部总经理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理；陈钢先生，固定收益总监兼固定收益部总经理；徐正国先生，天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理、天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）基金经理；钱文成先生，股票投资部总经理助理；高喜阳先生，股票投资部总经理助理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理、天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理；李继炜先生，天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理、天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号
办公地址：上海市江宁路168号
法定代表人：高建平
注册日期：1988年7月20日
注册资本：人民币107.86亿元
托管部门联系人：刘峰
电话：021-62677777*212017
传真：021-62159217

2、发展概况及财务状况：

兴业银行成立于1988年8月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本107.86亿元。

自开业以来，兴业银行始终坚持与客户“同发展、共成长”和“服务源自真诚”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2011年6月末，兴业银行资产总额突破2万亿元，达到20899.06亿元，股东权益1011.73亿元，不良贷款比率为0.35%，上半年累计实现净利润122.32亿元。根据美国《银行家》杂志2011年7月发布的全球银行1000强排名，兴业银行按总资产排名列第75位，按一级资本排名第83位。根据美国《福布斯》2010年发布的全球上市公司2000强排名，兴业银行综合排名第245位，在113家上榜的中国内地企业中排名第14位。

3、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合处、核算管理处、稽核监察处、市场处、产品研发处、委托资产管理处、企业年金中心共7个处室，共有员工70余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

4、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管资格批准文号：证监基金字［2005］74号。截止2012年3月31日，兴业银行已托管开放式基金14只——兴业趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、长盛货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业全球视野股票型证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）、天弘永利债券型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金、中欧沪深300指数增强型证券投资基金、民生加银内需增长股票型证券投资基金、兴全保本混合型证券投资基金、托管基金财产规模260.36亿元。

三、相关服务机构

（一）基金销售机构

1、直销机构：天弘基金管理有限公司
住所、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：李琦
联系人：蔡练
邮编：300203
电话：022-83865560
传真：022-83865563
网址：www.tffund.com.cn
客户服务热线：400-710-9999、022-83310988

2、代销机构

①）兴业银行股份有限公司
住所：福州市湖东路154号中山大厦
办公地址：上海市江宁路168号
法定代表人：高建平
电话：021-52629999
传真：021-62569070
联系人：刘玲
客户服务热线：95561
网址：www.cib.com.cn

②）中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
电话：010-66107913
传真：021-66107914
客户服务热线：95588
网址：www.icbc.com.cn

③）中国邮政储蓄银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街3号
办公地址：北京市西城区金融大街3号
法定代表人：李国华
电话：010-68858095
传真：010-68858117
联系人：陈春林
客户服务热线：95580
网址：www.psbc.com

④）中信银行股份有限公司
住所：北京市东城区朝阳门大街8号富华大厦C座
办公地址：北京市东城区朝阳门大街8号富华大厦C座
法定代表人：孔丹
电话：010-65557046
传真：010-65550827
联系人：赵树林
客户服务热线：95558
网址：www.bank.ecitic.com

⑤）交通银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
电话：021-58781234-1730
传真：021-58408483
联系人：林芳
客户服务热线：95559
网址：www.bankcomm.com

⑥）招商银行股份有限公司
住所：深圳市福田区深南大道7088号
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：傅育宁
电话：0755-83198888
传真：0755-83195109
联系人：邓炯鹏
客户服务热线：95555
网址：www.cmbchina.com

⑦）华夏银行股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦
办公地址：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦
法定代表人：吴建
电话：010-85238667
传真：010-85238680
联系人：郑鹏
客户服务热线：95577
网址：www.hxb.com.cn

⑧）中国建设银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼（长安兴融中心）
法定代表人：郭树清
电话：010-67596093
传真：010-66275654
联系人：何奕
客户服务热线：95533
网址：www.ccb.com

⑨）中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
电话：010-65183880
传真：010-65182261
联系人：权唐
客户服务热线：400-8888-108
网址：www.csc108.com

⑩）海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市黄浦区广东路689号10楼
法定代表人：王开国
电话：021-23219000
传真：021-23219100
联系人：李笑鸣
客户服务热线：95553或拨打各城市营业网点咨询电话
网址：www.htsec.com

⑪）申银万国证券股份有限公司
住所：上海市常熟路171号
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
电话：021-54041654
传真：021-54033888
联系人：李蓓怡
客户服务热线：95523或400-889-5523
网址：www.sywg.com.cn

⑫）中航证券有限公司
住所：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人：杜航
电话：0791-86768681
传真：0791-86770178
联系人：戴蕾
客户服务热线：400-886-6567
网址：www.avicsec.com

⑬）招商证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636
联系人：林生迎
客户服务热线：400-8888-111、95565
网址：www.newone.com.cn

⑭）渤海证券股份有限公司
住所：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市南开区宾水西道8号（奥体中心北侧）
法定代表人：杜庆平
电话：022-28451861
传真：022-28451892
联系人：王兆权
客户服务热线：400-6515-988
网址：www.bhzq.com.cn

⑮）华泰证券股份有限公司
住所：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：025-83290537
传真：025-51863323
联系人：孙雷雷
客户服务热线：400-8888-168、95597
网址：www.htsc.com.cn

⑯）齐鲁证券有限公司
住所：山东省济南市经七路86号
办公地址：山东省济南市经七路86号
法定代表人：李玮
电话：0531-68889155
传真：0531-68889752
联系人：吴阳
客户服务热线：95538
网址：www.qlzq.com.cn

⑰）华泰联合证券有限责任公司
住所：深圳市深南大道4011号香港中旅大厦第5层（01A、02、03、04）、17层、18层、24层、25层、26层
办公地址：深圳市深南大道4011号香港中旅大厦第5层（01A、02、03、04）、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人：马昭明
电话：0755-82492193
传真：0755-82492962
联系人：庞晓芸
客户服务热线：95513
网址：www.lhzq.com

⑱）山西证券股份有限公司
住所：太原市府西街69号山西国际贸易中心
办公地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心
法定代表人：侯巍
电话：0351-8686703
传真：0351-8686619
联系人：张洁茵
客户服务热线：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn

⑲）中国银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：顾伟国
电话：010-66568888
传真：010-66568536
联系人：田薇
客户服务热线：400-8888-888
网址：www.chinastock.com.cn

⑳）招商君安证券股份有限公司
住所：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
电话：021-38676161
传真：021-38670161
联系人：韩星宇
客户服务热线：400-8888-666
网址：www.gjsa.com

㉑）天相投资顾问有限公司
住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
电话：010-66045608
传真：010-66045500
联系人：林爽
客户服务热线：010-66045678
网址：jijin.txsec.com

㉒）中银国际证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦40层
法定代表人：许刚
电话：021-20328000
传真：021-50372474
联系人：李丹
客户服务热线：400-620-8888
网址：www.bocichina.com.cn

㉓）光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
电话：021-22169999
传真：021-22169134
联系人：刘晨
客户服务热线：400-888-8788、10108998
网址：www.ebscn.com

㉔）新时代证券有限责任公司
住所：北京市西城区金融街大街1号A座8层
办公地址：北京市西城区金融街大街1号A座8层
法定代表人：马金声
电话：010-83561149
传真：010-83561094
联系人：孙恺
客户服务热线：400-698-9898
网址：www.xsdzq.cn

㉕）长江证券股份有限公司
住所：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
电话：027-65799999
传真：027-85481900
联系人：李良
客户服务热线：95579或400-888-8999
网址：www.95579.com

㉖）平安证券有限责任公司
住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8层
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8层
法定代表人：杨宇翔
电话：0755-22626391
传真：0755-82400862
联系人：郑舒丽
客户服务热线：95511转8
网址：www.pingan.com.cn

㉗）世纪证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层
法定代表人：卢长才
电话：0755-83199599
传真：0755-83199545
联系人：方文
客户服务热线：0755-83199511
网址：www.csco.com.cn

㉘）上海证券有限责任公司
住所：上海市西藏中路336号
办公地址：上海市西藏中路336号
法定代表人：郁崇民
电话：021-53519888
传真：021-53519888
联系人：张瑾
客户服务热线：400-891-8918、021-962518
网址：www.shzq.com

㉙）宏信证券股份有限责任公司
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02
法定代表人：牛冠兴
电话：0755-82825551
传真：0755-82558355
联系人：陈剑虹
客户服务热线：400-800-1001
网址：www.essence.com.cn

㉚）宏源证券股份有限公司
住所：新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
电话：010-88085858
传真：010-88085195
联系人：李巍
客户服务热线：400-800-0562
网址：www.hysec.com

㉛）广州证券有限责任公司
住所：广州市先烈中路69号东山广场主楼17楼
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼
法定代表人：刘东
电话：020-88836999
传真：020-88836654
联系人：林洁茹
客户服务热线：021-961303
网址：www.gzs.com.cn

㉜）信达证券股份有限公司
住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：高冠江
电话：010-63081000
传真：010-63080978
联系人：唐静
客户服务热线：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

㉝）英大证券有限责任公司
住所：深圳市福田区深南中路华能大厦30、31层
办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦30、31层
法定代表人：赵文宏
电话：0755-83007069
传真：0755-83007167
联系人：王睿
客户服务热线：0755-26982993
网址：www.ydsc.com.cn

㉞）华安证券有限责任公司
住所：安徽省合肥市长江中路357号
办公地址：安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座24-32层
法定代表人：李工
电话：0551-5161666
传真：0551-5161600
联系人：甘霖
客户服务热线：96518、400-809-6518
网址：www.hazq.com

㉟）国联证券股份有限公司
住所：江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6层
办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702
法定代表人：雷建辉
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
联系人：沈刚
客户服务热线：95570
网址：www.glsc.com.cn

㊱）国金证券股份有限公司
住所：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
电话：028-86690126
传真：028-86690126
联系人：金喆
客户服务热线：400-660-0109
网址：www.gjzq.com.cn

㊲）东海证券有限责任公司
住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19号楼
办公地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19号楼
法定代表人：朱科敏
电话：0519-88157761
传真：0519-88157761
联系人：梁旭
客户服务热线：400-888-8588
网址：www.longone.com.cn

㊳）国信证券股份有限公司
住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人：何如
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
联系人：齐晓燕
客户服务热线：95536
网址：guosen.com.cn

㊴）西南证券股份有限公司
住所：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：王珠林
电话：023-63786464
传真：023-63786311
联系人：陈诚
客户服务热线：400-809-6096
网址：www.swsc.com.cn

㊵）华泰证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人：陈林
电话：021-50122222
传真：021-50122200
联系人：毛雪梅
客户服务热线：400-820-9898
网址：www.cnhhstock.com

㊶）西藏同信证券有限责任公司
住所：西藏自治区拉萨市北京中路101号
办公地址：上海市永和路118弄24号楼
法定代表人：贾绍君
电话：021-36533016
传真：021-36533017
联系人：王伟光
客户服务热线：400-881-1177
网址：www.xzsec.com

㊷）国元证券股份有限公司
住所：安徽省合肥市寿春路179号
办公地址：安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人：凤良志
电话：0551-2246273
传真：0551-2272100
联系人：陈琳琳
客户服务热线：95578
网址：www.gyzq.com.cn

㊸）华福证券有限责任公司
住所：福州市五四路157号新天地大厦
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7-10层
法定代表人：黄金琳
电话：0591-87383623
传真：0591-87383610
联系人：张腾
客户服务热线：0591-96326
网址：www.hfzq.com.cn

㊹）爱建证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人：郭林
电话：021-32229888
传真：021-68728782
联系人：陈敏
客户服务热线：021-63340678
网址：www.ajzq.com

㊺）万正证券股份有限公司
住所：长沙市芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址：长沙市芙蓉区芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
电话：0731-85832464
传真：0731-85832214
联系人：李芸
客户服务热线：95571
网址：www.foundersc.com

㊻）中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦20层
法定代表人：王东明
电话：010-60838888
传真：010-60833739
联系人：陈忠
客户服务热线：95558
网址：www.cs.ecitic.com

㊼）东莞证券有限责任公司
住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号
办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心30楼
法定代表人：张运勇
电话：0769-22116557
传真：0769-22119423
联系人：苏卓仁
客户服务热线：0769-961130
网址：www.dgzq.com.cn

㊽）民生证券有限责任公司
住所：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
法定代表人：余政
电话：010-85127622
传真：010-85127917
联系人：赵明
客户服务热线：400-619-8888
网址：www.mszq.com

㊾）中信万通证券有限责任公司
住所：山东省青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：杨宝林
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
联系人：吴忠超
客户服务热线：0532-96577
网址：www.zxwt.com.cn

㊿）中信证券（浙江）有限责任公司
住所：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦19层、20层
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦19层、20层
法定代表人：沈强
电话：0571-87112510
传真：0571-85783771
联系人：丁思聪
客户服务热线：0571-96598
网址：www.bigsun.com.cn

(51)中邮证券有限责任公司
住所：西安市碑林区太白北路320号
办公地址：西安市高新区唐延路5号陕西邮政大厦9-11层
法定代表人：李春太
电话：029-88602147
传真：029-88602150
联系人：王刚
客户服务热线：400-888-8005
网址：www.cnpsec.com.cn

(52)华龙证券有限责任公司
住所：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：甘肃省兰州市东岗西路638号财富大厦
法定代表人：李晓安
电话：0931-8784656
传真：0931-4890628
联系人：李昕田
客户服务热线：0931-4890208、0931-4890619
网址：www.hlzqgs.com

(53)华融证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市西城区金融大街8号A座3层
法定代表人：丁之锁
电话：010-58568040
传真：010-58568062
联系人：陶颖
客户服务热线：010-58568118
网址：www.hrsec.com.cn

(54)广发证券股份有限公司
住所：广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼
办公地址：广州市天河北路183号大都会广场18、19、36、38、41和42楼
法定代表人：林治海
电话：020-87555888
传真：020-87555305
联系人：黄凤
客户服务热线：95575或致电各地营业网点
网址：www.gf.com.cn

(55)新商证券有限责任公司
住所：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7楼
办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7楼
法定代表人：吴承根
电话：0571-87901912
传真：0571-87902092
联系人：许嘉行
客户服务热线：0571-967777
网址：www.stocke.com.cn

(56)招商证券股份有限公司
住所：广西桂林市铺里路13号
办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
法定代表人：张雅锋
电话：0755-83709350
传真：0755-83700205
联系人：牛孟宇
客户服务热线：95563
网址：www.ghzq.com.cn

（二）注册登记机构

名称：天弘基金管理有限公司
住所、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
邮编：300203
法定代表人：李琦
电话：022-83865598
传真：022-83865565
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
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10层1009-1010
法定代表人：孟卫民
电话：022-83865255
传真：022-83865266
联系人：续宏帆
经办律师：韩刚、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有限公司
办公地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人：杨绍信
电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：张鸿
经办注册会计师：薛竞、张鸿

四、基金的名称

本基金名称：天弘永利债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式（债券型）

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于固定收益类证券，包括国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转债（含分离交易可转债）、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，以及法律法规或中国证监会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%。

此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

八、基金的投资策略

1、资产配置

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，即债券、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。

2、固定收益类证券投资策略

①）债券资产配置

本基金通过对宏观经济、货币政策和债券市场的分析判断，把握市场利率的运行态势，根据债券市场收益率曲线的整体运动方向制定具体的投资策略，在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上，充分运用各种套利策略提升组合的持有期收益率，实现基金资产的保值增值。

①久期选择

本基金通过对宏观经济状况和货币政策的分析，根据中长期的宏观经济走势和经济周期性特征，对债券市场走势作出判断，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期限结构配置

在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构。通过对债券市场微观因素的分析，形成对未来收益率曲线形态变化的预期，相应地选择哑铃型、子弹型或阶梯型债券组合。

本基金主要考虑的债券市场微观因素包括：收益率曲线、历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等。

③债券类属配置

本基金根据对金融债、企业债（公司债）、可转债等债券品种与同期限国债之间利差（可转债为期权调整利差（OAS））的扩大和收窄的预期，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间相对价值变化所带来的投资收益。

②）个债选择

①普通债券的选择

本基金根据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、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

为控制基金债券投资的信用风险，本基金投资的企业债需经国内评级机构进行信用评估，要求其信用评级为投资级以上。如果债券获得主管机构的豁免评级，本基金根据对债券发行人的信用风险分析，决定是否将该债券纳入基金的投资范围。

另外，本基金还将根据债券市场的动态变化，采取多种灵活的动态增强型策略，如骑乘策略、息差策略、利差策略等，以获取超额收益。

②含权债券的选择

含权债券主要包括两类债券品种：含赎回或回售选择权的债券、含可转换为股本选择权的可转换公司债券。

本基金利用债券市场收益率数据，运用利率模型，计算含赎回或回售选择权的债券的期权调整利差（OAS），作为此类债券投资估值的主要依据。

可转换公司债券是一种介于股票和债券之间的债券衍生投资品种，投资者既可以获得债券投资的固定收益，也可以分享股票价格上涨所带来的投资回报。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转债的纯债价值和到期收益率来判断可转债的债性，以增强本金投资的安全性；利用可转债溢价率来判断可转债的股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种，获取超额收益。

为保持债券基金的收益风险特征，本基金可转换公司债券投资不超过基金资产净值的20%。

③资产支持证券的选择

本基金通过分析资产支持证券对应资产池的资产特征，来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支付，并利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。同时还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，控制资产支持证券投资的风险，以获取较高的投资收益。

3、权益类证券投资策略

①）新股申购策略

本基金可参与一级市场新股申购或增发新股等，包括在新股冻结期限内所发生的送股、配股、权证等权益投资。本基金管理人将利用公司的研究体系，对新股的行业属性和基本面作出判断，利用财务分析对公司的投资价值作出评估，从而进行合理询价。本基金将结合公司基本面、市场资金利率水平和可能的中签率作出是否参与新股申购的判断，通过新股申购主动优选股票，以获取一级市场与二级市场的价差收益。

②）二级市场股票投资策略

当本基金管理人判断市场出现明显的投资机会时，本基金可在授权范围内直接参与股票二级市场投资，以获取超额收益。本基金股票资产主要投资于两类公司：一是主营业务收入稳定增长、行业竞争优势明显、具有良好的现金分红纪录或现金分红潜力的优质上市公司。二是价值明显低估的公司。本基金从二级市场买入的股票必须全部来自于公司的核心股票库。

对于通过新股申购，可转债转股获得的股票，如不符合个股选择标准，本基金将在该股票上市后1个月内卖出。

④）权证投资策略

本基金对权证的投资建立在对标的证券和组合收益进行分析的基础之上，主要用于锁定收益和控制风险。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中信标普全债指数。

中信标普全债指数是一个全面反映整个债券市场（交易所债券市场、银行间债券市场）的综合性权威债券指数。针对我国债券市场，尤其是银行间债券市场流动性不足的问题，中信标普全债指数没有包含所有在银行间债券市场上市交易的品种，而是选择了部分交投比较活跃的银行间债券品种作为样本券，这样就更能够敏锐、直接、全面地反映市场对利率的预期及市场的走势。

随着我国债券市场的发展，将来如有更合适的指数推出，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成，业绩比较基准变更需经基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案。

十、风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券市场中的较低风险品种，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。

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