

天弘永利债券型证券投资基金

2022年第2季度报告

2022年06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:2022年07月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2022年07月19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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年04月01日起至2022年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | | | | |
|-----------------|--|-------------------|------------------|------------------|
| 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 | | | |
| 报告期末基金份额总额 | 33,805,798,861.40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获取较高的投资回报。 | | | |
| 投资策略 | 资产配置、固定收益类证券投资策略、权益类证券投资策略。 | | | |
| 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，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。 | | | |
| 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 | | | |
| 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 | 天弘永利 债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 420002 | 420102 | 002794 | 009610 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,537,160,557.72 | 24,627,830,106.43 | 2,183,723,272.79 | 3,457,084,924.46 |

| | | | | |
|--|---|---|---|---|
| | 份 | 份 | 份 | 份 |
|--|---|---|---|---|

§ 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(2022年04月01日 - 2022年06月30日) | | | |
|---------------------|--------------------------------|-----------------------|----------------------|----------------------|
| | 天弘永利债券 A | 天弘永利债券 B | 天弘永利债券 E | 天弘永利债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 12,870,807.4 4 | 119,767,312. 55 | 11,166,522.1 7 | 11,310,799.5 0 |
| 2. 本期利润 | 51,636,624.8 2 | 393,689,892. 38 | 32,883,491.7 8 | 43,749,211.8 0 |
| 3. 加权平均基金份额 本期利润 | 0.0160 | 0.0169 | 0.0140 | 0.0148 |
| 4. 期末基金资产净 值 | 4,187,484,28 9.58 | 29,208,977,6 86.64 | 2,387,889,51 7.70 | 3,681,883,06 5.11 |
| 5. 期末基金份额净 值 | 1.1839 | 1.1860 | 1.0935 | 1.0650 |

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。

3.2 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

天弘永利债券A净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 1.35% | 0.13% | 1.05% | 0.04% | 0.30% | 0.09% |
| 过去六个月 | -1.37% | 0.19% | 1.83% | 0.05% | -3.20% | 0.14% |
| 过去一年 | 7.23% | 0.25% | 4.77% | 0.05% | 2.46% | 0.20% |
| 过去三年 | 32.23% | 0.29% | 13.18% | 0.07% | 19.05% | 0.22% |

| | | | | | | |
|---------------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去五年 | 41.92% | 0.25% | 25.15% | 0.06% | 16.77% | 0.19% |
| 自基金合同 生效日起至 今 | 126.25% | 0.20% | 79.18% | 0.08% | 47.07% | 0.12% |

天弘永利债券B净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 1.45% | 0.13% | 1.05% | 0.04% | 0.40% | 0.09% |
| 过去六个月 | -1.18% | 0.19% | 1.83% | 0.05% | -3.01% | 0.14% |
| 过去一年 | 7.65% | 0.25% | 4.77% | 0.05% | 2.88% | 0.20% |
| 过去三年 | 33.81% | 0.30% | 13.18% | 0.07% | 20.63% | 0.23% |
| 过去五年 | 44.78% | 0.25% | 25.15% | 0.06% | 19.63% | 0.19% |
| 自基金合同 生效日起至 今 | 139.62% | 0.20% | 79.18% | 0.08% | 60.44% | 0.12% |

天弘永利债券E净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 1.46% | 0.13% | 1.05% | 0.04% | 0.41% | 0.09% |
| 过去六个月 | -1.17% | 0.19% | 1.83% | 0.05% | -3.00% | 0.14% |
| 过去一年 | 7.66% | 0.25% | 4.77% | 0.05% | 2.89% | 0.20% |
| 过去三年 | 33.82% | 0.29% | 13.18% | 0.07% | 20.64% | 0.22% |
| 过去五年 | 44.81% | 0.25% | 25.15% | 0.06% | 19.66% | 0.19% |
| 自基金份额 首次确认日 起至今 | 38.28% | 0.42% | 26.18% | 0.07% | 12.10% | 0.35% |

天弘永利债券C净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 1.37% | 0.13% | 1.05% | 0.04% | 0.32% | 0.09% |
| 过去六个月 | -1.33% | 0.19% | 1.83% | 0.05% | -3.16% | 0.14% |
| 过去一年 | 7.33% | 0.25% | 4.77% | 0.05% | 2.56% | 0.20% |
| 自基金份额 首次确认日 起至今 | 21.37% | 0.32% | 6.99% | 0.06% | 14.38% | 0.26% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



天弘永利债券B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2008年04月18日-2022年06月30日)



天弘永利债券E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年05月13日-2022年06月30日)



天弘永利债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同于2008年04月18日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3、本基金自2016年05月10日起增设天弘永利债券E基金份额。天弘永利债券E基金份额的首次确认日为2016年05月13日。本基金自2020年05月27日起增设天弘永利债券C基金份额。天弘永利债券C基金份额的首次确认日为2020年05月28日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 赵鼎龙 | 本基金基金经理 | 2021年11月 | - | 7年 | 男，电子学硕士。历任泰康资产管理有限责任公司固收交易员。2017年8月加盟本公司，历任固定收益机构投资部研究员、投资经理助理、基金经理助理。 |
| 杜广 | 本基金基金经理 | 2021 | - | 8 | 男，金融数学硕士。历任 |

| | | | | | |
|-----|---|----------|---|-----|--|
| | | 年06月 | | 年 | 泰康资产管理有限责任公司债券研究员、中国人寿养老保险股份有限公司债券研究员。2017年7月加盟本公司，历任投资经理助理、基金经理助理。 |
| 张寓 | 本基金基金经理 | 2021年03月 | - | 12年 | 男，金融学硕士。历任建信基金管理有限责任公司助理研究员、中信证券股份有限公司研究员、2013年1月加盟本公司，历任研究员、投资经理。 |
| 姜晓丽 | 固定收益业务总监、本基金基金经理，兼任固定收益部、宏观研究部、混合资产部总经理 | 2012年08月 | - | 13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。2011年8月加盟本公司，历任固定收益研究员、基金经理助理等。 |

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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合规守信情况的说明

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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度市场多数震荡,宏观层面,受疫情影响,经济表现较弱,货币政策维持了较为友好的货币环境,利于提升杠杆策略收益。机构行为方面,二季度前期受制于固收+类基金调整压力,市场有所调整,后续随着权益市场走强,固收+基金影响解除。同时,配置类投资者本季度相对表现偏弱,短债类投资者表现相对较强,收益曲线整体陡峭化。操作上我们底仓部分保持了较高的杠杆和中性偏低的久期,同时对长端进行利率债波段操作。组合的管理模式有一定的共性:①整体配置会保持低估值、均衡、分散的状态;②基于半年以上维度,维持一个稳定的核心持仓;③卫星持仓会根据风格、行业的性价比做一些灵活的切换和应对。

往前看,我们认为权益市场依然处于盈利见底反弹、估值偏低、流动性充裕三重因素共振的阶段,即便有交易行为导致的短期回调,幅度或也不会太深。此时,及时对结构的选择更为重要。

在胜率优先的配置方向上,我们前期底部增配了部分成长板块,但近期观测到相应行业指数的成交热度已经偏离历史均值3-5个标准差附近。且从微观角度看,龙头股的估值也基本修复到合理甚至偏贵的位置,因此对上述板块做了比较大的减持。后续我们看好如下方向:热度较低的成长板块细分领域,以及受益于消费场景再现的方向。

在赔率优先的配置方向上,我们看好并布局了如生猪养殖、地产产业链等赔率较高的方向,忍受一段时间底部的波动,以期获得比较好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2022年06月30日,天弘永利债券A基金份额净值为1.1839元,天弘永利债券B基金份额净值为1.1860元,天弘永利债券E基金份额净值为1.0935元,天弘永利债券C基金份额净值为1.0650元。报告期内份额净值增长率天弘永利债券A为1.35%,同期业绩比较基准增长率为1.05%;天弘永利债券B为1.45%,同期业绩比较基准增长率为1.05%;天弘永利债券E为1.46%,同期业绩比较基准增长率为1.05%;天弘永利债券C为1.37%,同期业绩比较基准增长率为1.05%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-----------------------|-------------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 3,185,143,688.53 | 7.53 |
| | 其中：股票 | 3,185,143,688.53 | 7.53 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 38,178,834,778.09 | 90.21 |
| | 其中：债券 | 38,178,834,778.09 | 90.21 |
| | 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 | 626,324,214.54 | 1.48 |
| 8 | 其他资产 | 329,839,160.65 | 0.78 |
| 9 | 合计 | 42,320,141,841.81 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 80,975,606.80 | 0.21 |
| C | 制造业 | 1,838,671,843.35 | 4.66 |
| D | 电力、热力、燃气及水生 生产和供应业 | 660,056,278.97 | 1.67 |
| E | 建筑业 | 220,394,437.38 | 0.56 |
| 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 | 73,818,000.00 | 0.19 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|------|
| J | 金融业 | 230,720,147.53 | 0.58 |
| K | 房地产业 | 80,507,374.50 | 0.20 |
| 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 | 3,185,143,688.53 | 8.07 |

5.3 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

| 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 | 600039 | 四川路桥 | 20,930,146 | 220,394,437.38 | 0.56 |
| 2 | 603601 | 再升科技 | 31,685,591 | 201,520,358.76 | 0.51 |
| 3 | 300257 | 开山股份 | 12,480,134 | 186,702,804.64 | 0.47 |
| 4 | 600483 | 福能股份 | 12,681,003 | 178,421,712.21 | 0.45 |
| 5 | 601985 | 中国核电 | 18,687,237 | 128,194,445.82 | 0.32 |
| 6 | 300415 | 伊之密 | 6,436,047 | 117,329,136.81 | 0.30 |
| 7 | 688007 | 光峰科技 | 4,330,632 | 105,234,357.60 | 0.27 |
| 8 | 600674 | 川投能源 | 8,571,859 | 102,176,559.28 | 0.26 |
| 9 | 600011 | 华能国际 | 13,805,804 | 97,192,860.16 | 0.25 |
| 10 | 002371 | 北方华创 | 350,500 | 97,130,560.00 | 0.25 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 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 | 407,762,624.43 | 1.03 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 12,652,995,781.36 | 32.06 |
| | 其中：政策性金融债 | 8,617,362,841.10 | 21.83 |
| 4 | 企业债券 | 12,793,124,442.81 | 32.42 |
| 5 | 企业短期融资券 | 265,958,489.86 | 0.67 |
| 6 | 中期票据 | 8,297,568,007.15 | 21.02 |
| 7 | 可转债(可交换债) | 3,416,903,762.21 | 8.66 |
| 8 | 同业存单 | 344,521,670.27 | 0.87 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 38,178,834,778.09 | 96.74 |

注：可转债项下包含可交换债222,238,408.20元。

5.5 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

| 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 | 210316 | 21进出16 | 10,000,000 | 1,047,343,835.62 | 2.65 |
| 2 | 2128046 | 21浦发银行02 | 8,800,000 | 899,513,867.40 | 2.28 |
| 3 | 210211 | 21国开11 | 7,900,000 | 805,487,463.01 | 2.04 |
| 4 | 180210 | 18国开10 | 7,200,000 | 789,369,534.25 | 2.00 |
| 5 | 2128035 | 21华夏银行02 | 6,900,000 | 708,059,889.86 | 1.79 |

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【广发银行股份有限公司】于2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【国家开发银行】于2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【华夏银行股份有限公司】于2021年08月13日收到中国人民银行出具公开处罚的通报，于2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【上海浦东发展银行股份有限公司】分别于2021年07月13日、2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【中国进出口银行】分别于2021年07月13日、2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 3,126,500.46 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 326,712,660.19 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 329,839,160.65 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|----------------|--------------|
| 1 | 123107 | 温氏转债 | 386,187,765.06 | 0.98 |
| 2 | 127049 | 希望转2 | 230,950,028.43 | 0.59 |
| 3 | 132018 | G三峡EB1 | 222,238,408.20 | 0.56 |
| 4 | 127018 | 本钢转债 | 193,054,550.90 | 0.49 |
| 5 | 110053 | 苏银转债 | 153,187,267.63 | 0.39 |

| | | | | |
|----|--------|-------|----------------|------|
| 6 | 127045 | 牧原转债 | 136,673,906.84 | 0.35 |
| 7 | 127030 | 盛虹转债 | 133,880,625.28 | 0.34 |
| 8 | 110081 | 闻泰转债 | 129,135,105.20 | 0.33 |
| 9 | 113050 | 南银转债 | 114,865,374.33 | 0.29 |
| 10 | 110075 | 南航转债 | 107,039,682.45 | 0.27 |
| 11 | 110072 | 广汇转债 | 88,975,922.04 | 0.23 |
| 12 | 127032 | 苏行转债 | 85,683,357.73 | 0.22 |
| 13 | 113623 | 凤21转债 | 80,631,248.99 | 0.20 |
| 14 | 110063 | 鹰19转债 | 48,548,752.22 | 0.12 |
| 15 | 128081 | 海亮转债 | 47,048,918.31 | 0.12 |
| 16 | 127022 | 恒逸转债 | 46,003,930.56 | 0.12 |
| 17 | 110047 | 山鹰转债 | 42,024,838.50 | 0.11 |
| 18 | 110043 | 无锡转债 | 38,854,723.36 | 0.10 |
| 19 | 113051 | 节能转债 | 38,652,621.36 | 0.10 |
| 20 | 127020 | 中金转债 | 38,367,627.57 | 0.10 |
| 21 | 113048 | 晶科转债 | 37,353,380.73 | 0.09 |
| 22 | 113045 | 环旭转债 | 35,517,471.04 | 0.09 |
| 23 | 110061 | 川投转债 | 35,226,884.32 | 0.09 |
| 24 | 110062 | 烽火转债 | 33,432,051.78 | 0.08 |
| 25 | 123056 | 雪榕转债 | 32,166,686.71 | 0.08 |
| 26 | 123077 | 汉得转债 | 32,078,024.41 | 0.08 |
| 27 | 128131 | 崇达转2 | 31,325,550.96 | 0.08 |
| 28 | 123049 | 维尔转债 | 30,587,070.37 | 0.08 |
| 29 | 113602 | 景20转债 | 27,006,596.98 | 0.07 |
| 30 | 113596 | 城地转债 | 24,579,295.48 | 0.06 |
| 31 | 128134 | 鸿路转债 | 22,539,396.38 | 0.06 |
| 32 | 113021 | 中信转债 | 21,875,978.08 | 0.06 |
| 33 | 127026 | 超声转债 | 18,477,845.62 | 0.05 |
| 34 | 123044 | 红相转债 | 17,631,246.98 | 0.04 |
| 35 | 123128 | 首华转债 | 17,290,835.12 | 0.04 |
| 36 | 128120 | 联诚转债 | 17,233,572.48 | 0.04 |
| 37 | 128109 | 楚江转债 | 16,322,626.88 | 0.04 |
| 38 | 113599 | 嘉友转债 | 11,346,999.61 | 0.03 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 39 | 123126 | 瑞丰转债 | 11,287,512.36 | 0.03 |
| 40 | 110073 | 国投转债 | 10,970,693.15 | 0.03 |
| 41 | 110067 | 华安转债 | 10,814,011.83 | 0.03 |
| 42 | 123115 | 捷捷转债 | 10,682,829.59 | 0.03 |
| 43 | 113535 | 大业转债 | 8,609,711.30 | 0.02 |
| 44 | 113615 | 金诚转债 | 8,074,755.16 | 0.02 |
| 45 | 113606 | 荣泰转债 | 7,684,816.19 | 0.02 |
| 46 | 127033 | 中装转2 | 7,574,862.84 | 0.02 |
| 47 | 113042 | 上银转债 | 7,261,753.13 | 0.02 |
| 48 | 113573 | 纵横转债 | 7,032,702.45 | 0.02 |
| 49 | 113025 | 明泰转债 | 6,853,791.78 | 0.02 |
| 50 | 113589 | 天创转债 | 6,387,254.92 | 0.02 |
| 51 | 128121 | 宏川转债 | 6,251,947.95 | 0.02 |
| 52 | 128123 | 国光转债 | 5,735,973.42 | 0.01 |
| 53 | 113569 | 科达转债 | 5,710,279.03 | 0.01 |
| 54 | 127047 | 帝欧转债 | 5,309,973.89 | 0.01 |
| 55 | 128063 | 未来转债 | 5,184,354.75 | 0.01 |
| 56 | 123076 | 强力转债 | 5,041,907.40 | 0.01 |
| 57 | 113563 | 柳药转债 | 4,890,369.89 | 0.01 |
| 58 | 113530 | 大丰转债 | 4,825,656.68 | 0.01 |
| 59 | 113608 | 威派转债 | 4,043,800.90 | 0.01 |
| 60 | 128138 | 侨银转债 | 3,315,807.93 | 0.01 |
| 61 | 128118 | 瀛通转债 | 3,149,091.90 | 0.01 |
| 62 | 123118 | 惠城转债 | 3,074,581.15 | 0.01 |
| 63 | 113578 | 全筑转债 | 2,078,770.50 | 0.01 |
| 64 | 127019 | 国城转债 | 1,974,067.25 | 0.01 |
| 65 | 113604 | 多伦转债 | 1,621,470.12 | 0.00 |
| 66 | 127024 | 盈峰转债 | 1,394,827.42 | 0.00 |
| 67 | 123104 | 卫宁转债 | 1,383,131.19 | 0.00 |
| 68 | 113033 | 利群转债 | 1,275,947.41 | 0.00 |
| 69 | 128105 | 长集转债 | 683,963.17 | 0.00 |
| 70 | 123101 | 拓斯转债 | 583,136.11 | 0.00 |

5.11.5 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。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 天弘永利债券 A | 天弘永利债券 B | 天弘永利债券 E | 天弘永利债券 C |
|---------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|----------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,027,395,11 2.97 | 23,176,960,4 37.05 | 2,712,332,28 2.19 | 2,789,859,75 4.16 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,318,150,79 7.80 | 7,102,224,27 5.02 | 457,060,907. 90 | 2,180,569,01 0.27 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 808,385,353. 05 | 5,651,354,60 5.64 | 985,669,917. 30 | 1,513,343,83 9.97 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 3,537,160,55 7.72 | 24,627,830,1 06.43 | 2,183,723,27 2.79 | 3,457,084,92 4.46 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定，调整了本基金在基金销售机构及直销机构的单笔最低申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额，并于2022年6月21日生效。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在基金销售机构及直销机构的单笔最低申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额的公告》。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘永利债券型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘永利债券型证券投资基金基金合同
- 3、天弘永利债券型证券投资基金托管协议
- 4、天弘永利债券型证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二二年七月二十一日