

天弘永利债券型证券投资基金

2022年第3季度报告

2022年09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10月26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10月24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07月01日起至2022年09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	33,024,933,100.56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	3,468,350,825.72	24,267,749,184.23	1,953,438,852.59	3,335,394,238.02

	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07月01日 - 2022年09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	18,962,973.76	165,056,546.16	12,914,862.62	16,969,365.98
2. 本期利润	-18,855,804.59	-102,967,237.48	-6,316,652.83	-17,548,374.86
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0054	-0.0041	-0.0030	-0.0052
4. 期末基金资产净值	4,088,267,348.18	28,647,727,452.40	2,125,881,603.77	3,537,816,286.45
5. 期末基金份额净值	1.1787	1.1805	1.0883	1.0607

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	-0.44%	0.14%	1.47%	0.05%	-1.91%	0.09%
过去六个月	0.91%	0.14%	2.54%	0.04%	-1.63%	0.10%
过去一年	0.95%	0.17%	4.59%	0.05%	-3.64%	0.12%
过去三年	30.97%	0.29%	13.26%	0.07%	17.71%	0.22%

过去五年	40.01%	0.26%	25.99%	0.06%	14.02%	0.20%
自基金合同生效日起至今	125.25%	0.20%	81.82%	0.08%	43.43%	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	-0.33%	0.15%	1.47%	0.05%	-1.80%	0.10%
过去六个月	1.12%	0.14%	2.54%	0.04%	-1.42%	0.10%
过去一年	1.35%	0.17%	4.59%	0.05%	-3.24%	0.12%
过去三年	32.54%	0.29%	13.26%	0.07%	19.28%	0.22%
过去五年	42.85%	0.26%	25.99%	0.06%	16.86%	0.20%
自基金合同生效日起至今	138.83%	0.20%	81.82%	0.08%	57.01%	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	-0.33%	0.15%	1.47%	0.05%	-1.80%	0.10%
过去六个月	1.12%	0.14%	2.54%	0.04%	-1.42%	0.10%
过去一年	1.35%	0.17%	4.59%	0.05%	-3.24%	0.12%
过去三年	32.56%	0.29%	13.26%	0.07%	19.30%	0.22%
过去五年	42.88%	0.26%	25.99%	0.06%	16.89%	0.20%
自基金份额首次确认日起至今	37.82%	0.41%	28.03%	0.07%	9.79%	0.34%

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	-0.40%	0.14%	1.47%	0.05%	-1.87%	0.09%
过去六个月	0.96%	0.14%	2.54%	0.04%	-1.58%	0.10%
过去一年	1.05%	0.17%	4.59%	0.05%	-3.54%	0.12%
自基金份额 首次确认日 起至今	20.88%	0.30%	8.56%	0.06%	12.32%	0.24%

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A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09月30日)



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09月30日)

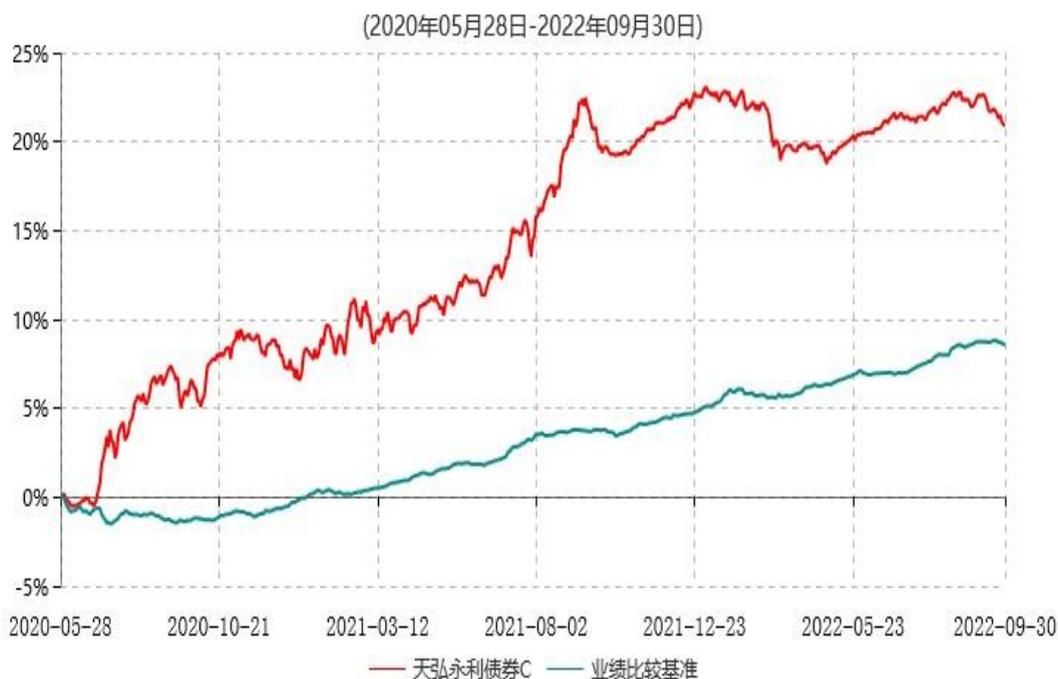


天弘永利债券E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年05月13日-2022年09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

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次,投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

3季度的市场表现比较弱势,一些降低估值的中小盘个股和转债的下跌幅度也是超过预期的,我们似乎又看到了类似4月份的因为流动性不足而无序定价的情况。事后去看,市场的下跌可以解释为市场对美联储的快速加息以及俄乌冲突升级的风险的恐惧,事前看,我们也很难判断已经处于相对底部的股市究竟定价了多少的风险。

展望未来的市场,短期,似乎一切都充满了不确定性;但拉长看,A股各个宽基指数基本都处在历史底部附近,这个位置往后获取绝对收益的概率较高。为客户的利益考虑,我们需要在此时付出一些情绪损耗,在弥漫的悲观情绪中保持积极的态度,维持偏高的仓位。在配置上,我们弱化了对风格的研判,而是强调自下而上选一些高性价比的方向和标的。对于核心持仓,依然倾向于在低估值、还有不错增长的传统行业,或者处于周期底部的行业里面进行选择。对于卫星持仓,我们倾向于选择一些低渗透率的成长方向,或者高景气板块的补涨标的进行配置。

3季度,我们保持了对股票的偏谨慎配置、对转债和债券进行了中性配置,在季度末逐步提高了股票仓位,风格上保持了价值股为主的结构,行业配置上向明确触底的地产链开始倾斜、一些制造业标的在景气度左侧位置也开始布局。投资的标准是:行业有成长性且在当前环境下从技术升级、国产替代或者能源角度受益;公司质地经过验证处于行业偏前列位置;估值整体不贵,合理或者偏低。

展望未来,随着股票市场的持续下跌,我们更加乐观:(1)稳健的居民资产负债表。在上半年,当对奥密克戎疫情的反复性有了认知之后,我们开始忧虑居民尤其是服务业收入的下降是否会带来居民资产负债表的损伤。然而,经历了近3年疫情的洗礼,我们看到居民的各种借款不良率稳定、存款总额增加、储蓄倾向上升,这些多增加的储蓄就是未来潜在的需求;(2)地产行业自去年以来经历了多重考验,6月开始地产销售数据开始企稳,7月断贷风波的极限测试之后,数据依然稳健,随着政策的持续暖意,我们认为地产行业底部可能已经探明;(3)随着人们对奥密克戎特性理解的加深、各地应对政策的娴熟,我们认为疫情的冲击将有可能淡化,我们期待消费场景恢复的可能

性；（4）随着终端出口需求的下滑，工业部门的生产和库存也将出现下行，对于中国经济我们尚在担忧的风险预计在四季度到明年一季度得到释放。

后续我们会继续在市场下跌过程中逐步加仓，在上述几条逻辑线上、在我们的投资标准框架内进行左侧布局。三季度市场收益率下行后反弹。宏观层面，在疫情与地产双重压力下，经济继续处于利多债市环境，但9月底经济刺激政策频出，收益率快速上行。机构行为层面，三季度继续维持较强的中短债配置力量，使得信用利差进一步走低。操作层面，我们底仓继续以2-3年信用债为主，长端少量参与波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2022年09月30日，天弘永利债券A基金份额净值为1.1787元，天弘永利债券B基金份额净值为1.1805元，天弘永利债券E基金份额净值为1.0883元，天弘永利债券C基金份额净值为1.0607元。报告期内份额净值增长率天弘永利债券A为-0.44%，同期业绩比较基准增长率为1.47%；天弘永利债券B为-0.33%，同期业绩比较基准增长率为1.47%；天弘永利债券E为-0.33%，同期业绩比较基准增长率为1.47%；天弘永利债券C为-0.40%，同期业绩比较基准增长率为1.47%。

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	3,555,417,987.06	8.32
	其中：股票	3,555,417,987.06	8.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,390,110,475.37	89.86
	其中：债券	38,390,110,475.37	89.86
	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	-375,734.50	0.00
	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	368,837,081.34	0.86

	计		
8	其他资产	408,830,190.00	0.96
9	合计	42,722,819,999.27	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	84,432,735.20	0.22
C	制造业	1,806,390,456.32	4.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	733,871,028.48	1.91
E	建筑业	246,749,772.12	0.64
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	127,797,478.16	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,845,663.60	0.24
J	金融业	160,288,499.05	0.42
K	房地产业	305,042,354.13	0.79
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	3,555,417,987.06	9.26

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	22,417,946	229,111,408.12	0.60
2	601985	中国核电	35,444,192	207,348,523.20	0.54
3	300257	开山股份	10,024,434	186,354,228.06	0.49
4	603601	再升科技	31,685,591	168,250,488.21	0.44
5	600483	福能股份	14,578,203	155,840,990.07	0.41
6	300737	科顺股份	13,650,027	129,948,257.04	0.34
7	001914	招商积余	8,487,200	129,514,672.00	0.34
8	601601	中国太保	6,138,985	124,805,565.05	0.33
9	300408	三环集团	4,585,902	119,416,888.08	0.31
10	600011	华能国际	15,308,404	116,190,786.36	0.30

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	181,855,509.59	0.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,511,227,786.86	27.37
	其中：政策性金融债	6,250,085,517.82	16.28
4	企业债券	13,013,899,872.48	33.89
5	企业短期融资券	10,124,256.44	0.03
6	中期票据	10,059,316,217.55	26.20
7	可转债（可交换债）	4,138,119,844.48	10.78
8	同业存单	475,566,987.97	1.24
9	其他	-	-
10	合计	38,390,110,475.37	99.98

注:可转债项下包含可交换债69,308,260.47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	1,030,217,808.22	2.68
2	2128046	21浦发银行02	8,800,000	911,032,030.68	2.37
3	2128035	21华夏银行02	7,700,000	800,171,342.47	2.08
4	2128041	21广发银行小微债	5,700,000	592,050,504.66	1.54
5	170208	17国开08	5,000,000	521,515,068.49	1.36

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】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;【招商证券股份有限公司】于2022年08月12日收到中国证券监督管理委员会出具立案调查的通报,于2022年09月19日收到中国证券监督管理委员会出具责令改正、公开处罚的通报;【中国进出口银行】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；【中国农业发展银行】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；【中国银行股份有限公司】分别于2022年03月21日、2022年05月26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	2,687,841.47
2	应收证券清算款	355,158,248.94
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50,984,099.59
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	408,830,190.00

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	127018	本钢转债	280,337,083.72	0.73
2	113050	南银转债	267,949,351.36	0.70
3	127049	希望转2	222,262,916.83	0.58
4	110081	闻泰转债	198,071,296.82	0.52
5	110053	苏银转债	179,192,859.59	0.47
6	113641	华友转债	177,431,365.72	0.46
7	127045	牧原转债	167,031,298.01	0.43
8	123107	温氏转债	134,115,773.55	0.35
9	127032	苏行转债	128,329,361.93	0.33
10	127022	恒逸转债	125,404,711.35	0.33
11	127040	国泰转债	107,870,353.14	0.28
12	110072	广汇转债	106,033,642.82	0.28
13	110075	南航转债	103,258,813.37	0.27
14	113623	凤21转债	88,409,982.24	0.23
15	113602	景20转债	78,542,881.02	0.20

16	113054	绿动转债	76,405,130.12	0.20
17	127020	中金转债	75,568,686.14	0.20
18	110043	无锡转债	75,200,676.01	0.20
19	132018	G三峡EB1	69,308,260.47	0.18
20	113045	环旭转债	68,506,511.46	0.18
21	113048	晶科转债	61,897,808.88	0.16
22	128131	崇达转2	56,711,034.29	0.15
23	128109	楚江转债	54,786,636.38	0.14
24	110063	鹰19转债	53,293,704.80	0.14
25	113057	中银转债	41,781,953.42	0.11
26	110047	山鹰转债	41,691,368.63	0.11
27	110084	贵燃转债	37,807,781.21	0.10
28	113051	节能转债	37,066,380.40	0.10
29	127027	靖远转债	35,512,819.31	0.09
30	113056	重银转债	34,633,831.88	0.09
31	128134	鸿路转债	34,516,393.26	0.09
32	123128	首华转债	34,373,693.35	0.09
33	110062	烽火转债	32,630,869.10	0.08
34	123056	雪榕转债	32,446,354.93	0.08
35	127030	盛虹转债	32,215,015.61	0.08
36	128081	海亮转债	32,098,080.40	0.08
37	123049	维尔转债	30,154,459.13	0.08
38	123077	汉得转债	29,741,570.65	0.08
39	113563	柳药转债	25,185,643.77	0.07
40	113596	城地转债	24,146,032.71	0.06
41	128108	蓝帆转债	22,811,450.84	0.06
42	113021	中信转债	22,088,734.25	0.06
43	113046	金田转债	21,259,498.12	0.06
44	113033	利群转债	20,632,306.80	0.05
45	123131	奥飞转债	18,519,669.09	0.05
46	127026	超声转债	18,023,296.08	0.05
47	123115	捷捷转债	16,072,243.33	0.04
48	128141	旺能转债	15,066,737.39	0.04

49	128121	宏川转债	14,754,752.40	0.04
50	128075	远东转债	14,548,331.07	0.04
51	113055	成银转债	11,939,422.80	0.03
52	113622	杭叉转债	11,904,490.54	0.03
53	123126	瑞丰转债	10,803,582.50	0.03
54	110067	华安转债	10,703,176.56	0.03
55	110073	国投转债	10,693,954.84	0.03
56	113606	荣泰转债	9,342,882.98	0.02
57	113642	上22转债	9,329,409.53	0.02
58	113573	纵横转债	9,100,149.91	0.02
59	113535	大业转债	8,491,711.82	0.02
60	113604	多伦转债	7,657,019.55	0.02
61	113042	上银转债	7,370,346.72	0.02
62	113632	鹤21转债	7,249,175.02	0.02
63	127033	中装转2	6,964,754.89	0.02
64	123078	飞凯转债	6,753,488.19	0.02
65	110074	精达转债	6,520,228.15	0.02
66	113589	天创转债	6,354,996.32	0.02
67	113569	科达转债	5,672,686.51	0.01
68	128123	国光转债	5,506,265.11	0.01
69	128063	未来转债	5,155,940.74	0.01
70	127047	帝欧转债	4,992,511.25	0.01
71	123076	强力转债	4,946,023.81	0.01
72	113530	大丰转债	4,693,758.39	0.01
73	123044	红相转债	4,438,977.17	0.01
74	113608	威派转债	3,971,502.42	0.01
75	110077	洪城转债	3,898,620.80	0.01
76	128138	侨银转债	3,373,543.46	0.01
77	127024	盈峰转债	3,192,448.89	0.01
78	123118	惠城转债	3,120,864.49	0.01
79	113025	明泰转债	2,662,720.55	0.01
80	127050	麒麟转债	1,972,553.53	0.01
81	111001	山玻转债	1,569,784.84	0.00

82	123104	卫宁转债	1,329,196.11	0.00
83	118003	华兴转债	926,650.88	0.00
84	128105	长集转债	693,569.50	0.00
85	123101	拓斯转债	574,343.94	0.00
86	123059	银信转债	444,791.50	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	3,537,160,55 7.72	24,627,830,1 06.43	2,183,723,27 2.79	3,457,084,92 4.46
报告期期间基金总申购份额	907,448,912. 14	5,232,121,41 0.32	305,211,033. 23	2,128,850,76 3.00
减：报告期期间基金总赎回份额	976,258,644. 14	5,592,202,33 2.52	535,495,453. 43	2,250,541,44 9.44
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	3,468,350,82 5.72	24,267,749,1 84.23	1,953,438,85 2.59	3,335,394,23 8.02

§ 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，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 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
二〇二二年十月二十六日