

---

天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）

2023年第3季度报告

2023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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2023年10月25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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月23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2023年07月01日起至2023年09月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	天弘丰利债券(LOF)	
场内简称	天弘丰利LOF	
基金主代码	164208	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年11月23日	
报告期末基金份额总额	972,324,602.25份	
投资目标	本基金在追求基金资产稳定增值的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	资产配置策略、信用债券投资策略、国债及央行票据投资策略、新股申购策略等。	
业绩比较基准	中债综合指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	天弘丰利债券(LOF)E	天弘丰利债券(LOF)C
下属分级基金场内简称	天弘丰利LOF	-
下属分级基金的交易代码	164208	015563
报告期末下属分级基金的份额总	927,722,710.09份	44,601,892.16份

额		
---	--	--

### §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(2023年07月01日 - 2023年09月30日)	
	天弘丰利债券(LOF)E	天弘丰利债券(LOF)C
1.本期已实现收益	1,299,139.08	54,952.70
2.本期利润	1,315,667.10	24,339.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0014	0.0004
4.期末基金资产净值	1,195,054,811.13	45,893,634.63
5.期末基金份额净值	1.2882	1.0290

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

天弘丰利债券(LOF)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	0.09%	0.17%	0.01%	0.05%	0.08%	0.12%
过去六个月	0.20%	0.19%	0.95%	0.04%	-0.75%	0.15%
过去一年	2.36%	0.24%	0.62%	0.05%	1.74%	0.19%
过去三年	14.67%	0.24%	4.54%	0.05%	10.13%	0.19%
过去五年	28.31%	0.19%	7.27%	0.06%	21.04%	0.13%
自基金转型 日起至今	53.26%	0.17%	8.08%	0.07%	45.18%	0.10%

天弘丰利债券(LOF)C净值表现

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	0.08%	0.17%	0.01%	0.05%	0.07%	0.12%
过去六个月	0.18%	0.19%	0.95%	0.04%	-0.77%	0.15%
过去一年	2.16%	0.24%	0.62%	0.05%	1.54%	0.19%
自基金份额 首次确认日 起至今	2.90%	0.26%	1.36%	0.05%	1.54%	0.21%

### 3.2.2 自基金转型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

天弘丰利债券(LOF)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  
(2014年11月25日-2023年09月30日)



天弘丰利债券(LOF)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  
(2022年04月18日-2023年09月30日)



注：1、本基金合同于2011年11月23日生效，本基金于2014年11月24日三年封闭期届满，封闭期届满后本基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）”，封闭期届满日为本基金份额转换基准日。

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2022年04月15日起增设天弘丰利债券(LOF)C基金份额。天弘丰利债券(LOF)C基金份额的首次确认日为2022年04月18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		
杜广	本基金基金经理	2020年12月	-	9年	男，应用经济学博士。历任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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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，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

权益市场的情绪已经到了冰点，一些积极的变化也在被无视。第一个积极的变化在于从PMI的数据来看，3季度的经济在逐月逐步回暖；第二个积极的变化在于监管层出台了一些长期对股市有利的政策，比如对股东减持的规范、鼓励分红、对股权融资行为的约束等等。对于第二点积极的变化，我们认为非常重要，可能已经在对过去十几年A股市场的顽疾对症下药。

尽管市场依旧在惯性下跌，但我们认为现在是需要积极作为的时刻。被下跌带来的负面情绪所裹挟而做出不当的决策，是最危险的事情。也许，作为基金经理的职责就是替客户在市场最悲观的时刻，承受住所有的负面情绪，积极挖掘机会、主动承担风险，在严冬中去埋下一粒粒种子。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2023年09月30日，天弘丰利债券(LOF)E基金份额净值为1.2882元，天弘丰利债券(LOF)C基金份额净值为1.0290元。报告期内份额净值增长率天弘丰利债券(LOF)E为0.09%，同期业绩比较基准增长率为0.01%；天弘丰利债券(LOF)C为0.08%，同期业绩比较基准增长率为0.01%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,529,700,776.66	97.38
	其中：债券	1,529,700,776.66	97.38
	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	9,500,000.00	0.60
	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	30,451,038.33	1.94
8	其他资产	1,179,068.73	0.08
9	合计	1,570,830,883.72	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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	50,173,315.40	4.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	516,716,097.91	41.64
	其中：政策性金融债	516,716,097.91	41.64
4	企业债券	492,067,850.94	39.65
5	企业短期融资券	2,038,036.82	0.16
6	中期票据	92,065,240.41	7.42
7	可转债（可交换债）	376,640,235.18	30.35
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,529,700,776.66	123.27

#### 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	150218	15国开18	2,500,000	256,911,475.41	20.70
2	190204	19国开04	1,000,000	105,117,835.62	8.47
3	210203	21国开03	1,000,000	104,021,475.41	8.38
4	149274	20申证10	900,000	92,522,120.54	7.46
5	175535	20华泰G9	700,000	71,875,179.18	5.79

**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 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票，故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	113,667.13
2	应收证券清算款	1,047,821.24
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,580.36
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,179,068.73

#### 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	127027	能化转债	18,508,398.61	1.49
2	128141	旺能转债	17,684,925.80	1.43
3	127058	科伦转债	14,715,329.80	1.19
4	127075	百川转2	14,706,911.86	1.19
5	127063	贵轮转债	12,397,953.05	1.00
6	123158	宙邦转债	11,635,394.35	0.94
7	127070	大中转债	11,352,590.47	0.91
8	123085	万顺转2	10,104,350.68	0.81
9	113648	巨星转债	10,082,077.74	0.81
10	113057	中银转债	9,498,343.71	0.77
11	128087	孚日转债	9,387,318.49	0.76
12	127006	敖东转债	8,518,978.45	0.69

13	123152	润禾转债	7,815,188.33	0.63
14	113663	新化转债	7,323,824.55	0.59
15	123157	科蓝转债	7,301,438.26	0.59
16	123156	博汇转债	7,032,294.43	0.57
17	123099	普利转债	6,731,630.64	0.54
18	113637	华翔转债	6,727,172.80	0.54
19	123141	宏丰转债	6,664,542.69	0.54
20	113649	丰山转债	6,614,399.45	0.53
21	110077	洪城转债	6,403,509.30	0.52
22	111004	明新转债	6,383,646.42	0.51
23	113060	浙22转债	6,299,308.88	0.51
24	113025	明泰转债	6,255,177.71	0.50
25	113667	春23转债	6,010,660.34	0.48
26	110048	福能转债	5,639,666.00	0.45
27	123182	广联转债	5,550,436.25	0.45
28	111000	起帆转债	5,299,039.38	0.43
29	113601	塞力转债	4,966,172.38	0.40
30	123092	天壕转债	4,882,013.92	0.39
31	123120	隆华转债	4,711,959.59	0.38
32	123176	精测转2	4,443,471.86	0.36
33	128128	齐翔转2	3,969,474.71	0.32
34	123112	万讯转债	3,907,698.62	0.31
35	123050	聚飞转债	3,866,916.48	0.31
36	113600	新星转债	3,664,488.25	0.30
37	127047	帝欧转债	3,663,089.38	0.30
38	123130	设研转债	3,660,825.59	0.30
39	123063	大禹转债	2,680,159.14	0.22
40	118009	华锐转债	2,485,719.58	0.20
41	123140	天地转债	2,422,495.58	0.20
42	118021	新致转债	2,346,231.86	0.19
43	113609	永安转债	2,337,632.88	0.19
44	113604	多伦转债	2,018,964.00	0.16
45	128091	新天转债	1,725,724.60	0.14

46	110080	东湖转债	1,716,289.23	0.14
47	127053	豪美转债	1,621,654.16	0.13
48	127020	中金转债	1,487,705.60	0.12
49	110091	合力转债	1,473,282.00	0.12
50	127035	濮耐转债	1,289,198.07	0.10
51	127078	优彩转债	1,278,854.43	0.10
52	123160	泰福转债	1,262,220.15	0.10
53	123089	九洲转2	1,259,691.78	0.10
54	127079	华亚转债	1,249,472.01	0.10
55	127033	中装转2	1,241,885.84	0.10
56	113598	法兰转债	1,146,190.68	0.09
57	128066	亚泰转债	1,126,173.41	0.09
58	123059	银信转债	1,116,612.86	0.09
59	128063	未来转债	1,000,140.35	0.08
60	111008	沿浦转债	982,512.31	0.08
61	113577	春秋转债	666,190.86	0.05
62	123129	锦鸡转债	656,795.51	0.05
63	113660	寿22转债	652,227.07	0.05
64	123150	九强转债	652,059.26	0.05
65	123080	海波转债	651,497.37	0.05
66	113631	皖天转债	643,076.56	0.05
67	128133	奇正转债	642,795.98	0.05
68	127028	英特转债	640,558.60	0.05
69	123174	精锻转债	639,591.02	0.05
70	118016	京源转债	638,971.40	0.05
71	113058	友发转债	638,712.90	0.05
72	113066	平煤转债	638,393.68	0.05
73	111005	富春转债	637,470.40	0.05
74	118028	会通转债	635,862.18	0.05
75	123167	商络转债	635,797.22	0.05
76	127054	双箭转债	635,198.29	0.05
77	111011	冠盛转债	634,457.76	0.05
78	110084	贵燃转债	634,161.72	0.05

79	128081	海亮转债	633,707.25	0.05
80	128121	宏川转债	633,119.74	0.05
81	113628	晨丰转债	633,077.40	0.05
82	123147	中辰转债	633,057.00	0.05
83	113546	迪贝转债	632,323.79	0.05
84	123162	东杰转债	630,533.00	0.05
85	128130	景兴转债	630,093.97	0.05
86	127069	小熊转债	629,869.25	0.05
87	111012	福新转债	629,326.73	0.05
88	111002	特纸转债	626,697.12	0.05
89	127050	麒麟转债	626,440.13	0.05
90	123146	中环转2	623,054.10	0.05
91	113561	正裕转债	619,037.35	0.05
92	113664	大元转债	617,365.98	0.05
93	123166	蒙泰转债	606,740.41	0.05
94	123100	朗科转债	308,809.48	0.02
95	123164	法本转债	228,794.12	0.02
96	123171	共同转债	4,649.17	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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

	天弘丰利债券(LOF)E	天弘丰利债券(LOF)C
报告期期初基金份额总额	1,019,643,355.77	58,039,457.43
报告期期间基金总申购份额	3,899,136.83	771,226.64
减：报告期期间基金总赎回份额	95,819,782.51	14,208,791.91
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	927,722,710.09	44,601,892.16

## §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，韩歆毅先生代任公司总经理，郭树强先生不再担任公司总经理，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高级管理人员变更的公告》。

## §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丰利分级债券型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）托管协议
- 4、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）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住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](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二三年十月二十五日