

---

# 天弘永利债券型证券投资基金

## 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:兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	27,119,489,588.02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	2,823,776,3 37.66份	20,713,429, 665.11份	1,311,352,0 02.31份	2,270,931,5 82.94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(2023年07月01日 - 2023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	1,791,451.89	36,884,245.88	1,982,846.49	1,952,618.39
2.本期利润	9,725,428.12	92,873,376.10	5,109,175.41	8,972,326.67
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0033	0.0044	0.0039	0.0037
4.期末基金资产净 值	3,330,558,944. 09	24,450,056,31 1.76	1,427,060,458. 30	2,408,838,746. 91
5.期末基金份额净 值	1.1795	1.1804	1.0882	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	0.27%	0.14%	0.68%	0.04%	-0.41%	0.10%
过去六个月	-0.09%	0.19%	2.36%	0.04%	-2.45%	0.15%
过去一年	2.17%	0.20%	3.31%	0.05%	-1.14%	0.15%
过去三年	16.66%	0.26%	13.58%	0.05%	3.08%	0.21%
过去五年	46.61%	0.26%	24.02%	0.06%	22.59%	0.20%
自基金合同 生效日起至	130.14%	0.20%	87.83%	0.08%	42.31%	0.12%

今						
---	--	--	--	--	--	--

## 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	0.37%	0.14%	0.68%	0.04%	-0.31%	0.10%
过去六个月	0.11%	0.19%	2.36%	0.04%	-2.25%	0.15%
过去一年	2.57%	0.20%	3.31%	0.05%	-0.74%	0.15%
过去三年	18.06%	0.26%	13.58%	0.05%	4.48%	0.21%
过去五年	49.55%	0.26%	24.02%	0.06%	25.53%	0.20%
自基金合同生效日起至今	144.97%	0.20%	87.83%	0.08%	57.14%	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	0.37%	0.14%	0.68%	0.04%	-0.31%	0.10%
过去六个月	0.10%	0.19%	2.36%	0.04%	-2.26%	0.15%
过去一年	2.57%	0.20%	3.31%	0.05%	-0.74%	0.15%
过去三年	18.06%	0.26%	13.58%	0.05%	4.48%	0.21%
过去五年	49.53%	0.26%	24.02%	0.06%	25.51%	0.20%
自基金份额首次确认日起至今	41.36%	0.39%	32.27%	0.07%	9.09%	0.32%

## 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	0.29%	0.14%	0.68%	0.04%	-0.39%	0.10%

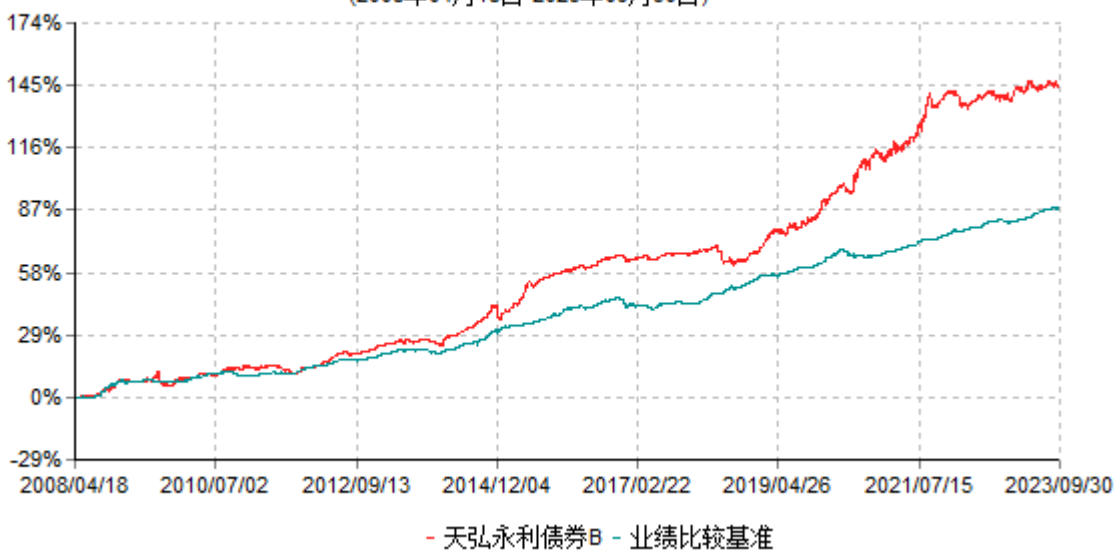
过去六个月	-0.04%	0.19%	2.36%	0.04%	-2.40%	0.15%
过去一年	2.26%	0.20%	3.31%	0.05%	-1.05%	0.15%
过去三年	17.00%	0.26%	13.58%	0.05%	3.42%	0.21%
自基金份额 首次确认日 起至今	23.62%	0.28%	12.15%	0.06%	11.47%	0.22%

### 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-2023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-2023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-2023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  
(2020年05月28日-2023年09月30日)



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	说明

		任职日期	离任日期	年限	
赵鼎龙	本基金基金经理	2021年11月	-	8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。
杜广	本基金基金经理	2021年06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。
张寓	本基金基金经理	2021年03月	-	13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、混合资产部部门总经理	2012年08月	-	14年	女，经济学硕士。历任本公司债券研究员、债券交易员、光大永明人寿保险有限公司债券研究员、债券交易员。2011年8月加盟本公司，历任固定收益研究员等。

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不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

经历过2季度的超预期的经济压力后，3季度我们观察到经济触底的迹象越来越多，从海外经济到国内经济；同时，随着经济压力的加大，国内宏观政策非常积极；同时，我们看到中美关系的改善。这些都加强了我们对股票市场的判断，我们认为未来两个季度将是股票市场相对宝贵的配置窗口，之后的不确定性还比较多。这中间也有一些质疑点，汇率可能是个重要方面，但我们认为，从2022年开始的人民币贬值已经走到了末段位置，当下的发酵和关注更多是市场滞后的反应，不能作为领先指标。所以，基于基本面的改善，我们基于绝对收益的思路提高了股票仓位。

从行业配置上，从周期的角度我们更加重视了上游，对中游偏向谨慎一点，对一些有价值的消费类逐步的研究配置起来。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。宏观层面，三季度经济复苏不及预期利多债券市场，政策



层面，央行再次降准降息呵护市场流动性。行为层面，保险和理财配置力量持续较高，但9月有所下降。操作上三季度保持偏乐观状态，季末略微降低久期。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2023年09月30日，天弘永利债券A基金份额净值为1.1795元，天弘永利债券B基金份额净值为1.1804元，天弘永利债券E基金份额净值为1.0882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0.27%，同期业绩比较基准增长率为0.68%；天弘永利债券B为0.37%，同期业绩比较基准增长率为0.68%；天弘永利债券E为0.37%，同期业绩比较基准增长率为0.68%；天弘永利债券C为0.29%，同期业绩比较基准增长率为0.68%。

#### 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	4,139,408,881.84	11.82
	其中：股票	4,139,408,881.84	11.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,344,648,329.78	86.67
	其中：债券	30,344,648,329.78	86.67
	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	358,616,158.15	1.02
8	其他资产	167,098,187.90	0.48
9	合计	35,009,771,557.67	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	119,492,177.40	0.38
B	采矿业	454,205,406.62	1.44
C	制造业	2,327,851,942.84	7.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	101,044,630.00	0.32
E	建筑业	411,253,526.24	1.30
F	批发和零售业	121,199,715.00	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	6,182,220.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	448,149,195.41	1.42
K	房地产业	105,105,681.33	0.33
L	租赁和商务服务业	37,005,827.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,918,560.00	0.03
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	4,139,408,881.84	13.09

### 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	002833	弘亚数控	14,483,810	283,882,676.00	0.90
2	600938	中国海油	10,608,984	224,273,921.76	0.71
3	600970	中材国际	18,750,450	211,505,076.00	0.67
4	300408	三环集团	6,653,802	206,267,862.00	0.65
5	601117	中国化学	25,674,608	199,748,450.24	0.63

6	603337	杰克股份	9,199,292	195,484,955.00	0.62
7	601318	中国平安	3,993,500	192,886,050.00	0.61
8	688007	光峰科技	6,926,775	175,940,085.00	0.56
9	600309	万华化学	1,864,700	164,690,304.00	0.52
10	000680	山推股份	30,668,992	147,211,161.60	0.47

#### 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	1,677,106,495.72	5.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,086,216,609.29	25.58
	其中：政策性金融债	3,442,228,131.77	10.89
4	企业债券	10,830,015,207.78	34.25
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	5,871,496,384.29	18.57
7	可转债（可交换债）	3,829,879,447.92	12.11
8	同业存单	49,934,184.78	0.16
9	其他	-	-
10	合计	30,344,648,329.78	95.98

#### 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	8,500,000	869,381,393.44	2.75
2	019703	23国债10	7,600,000	766,102,904.12	2.42
3	170208	17国开08	5,000,000	511,358,469.95	1.62
4	220024	22付息国债24	4,700,000	484,031,426.23	1.53
5	232380015	23工行二级资本债01A	4,100,000	421,037,558.47	1.33

#### 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 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	2,179,442.83
2	应收证券清算款	122,858,048.69
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	42,060,696.38
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	167,098,187.90

#### 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	113641	华友转债	191,207,369.38	0.60
2	113065	齐鲁转债	181,899,598.35	0.58
3	127049	希望转2	175,779,716.19	0.56
4	127061	美锦转债	172,857,315.75	0.55
5	127045	牧原转债	169,094,598.09	0.53

6	111010	立昂转债	166,131,123.93	0.53
7	127022	恒逸转债	156,723,850.99	0.50
8	113050	南银转债	156,293,130.51	0.49
9	110072	广汇转债	102,552,665.67	0.32
10	113045	环旭转债	95,770,607.17	0.30
11	123107	温氏转债	93,391,046.27	0.30
12	113054	绿动转债	77,293,252.94	0.24
13	113623	凤21转债	74,916,450.61	0.24
14	113060	浙22转债	71,251,237.62	0.23
15	127027	能化转债	66,640,963.40	0.21
16	110081	闻泰转债	65,454,570.28	0.21
17	128109	楚江转债	59,380,224.99	0.19
18	128131	崇达转2	58,167,054.31	0.18
19	113033	利群转债	56,412,766.23	0.18
20	110063	鹰19转债	54,935,960.00	0.17
21	123128	首华转债	53,840,584.82	0.17
22	113602	景20转债	51,272,691.98	0.16
23	113055	成银转债	46,845,615.65	0.15
24	110085	通22转债	41,475,700.00	0.13
25	127020	中金转债	40,165,955.84	0.13
26	127030	盛虹转债	37,894,058.95	0.12
27	118019	金盘转债	35,509,993.69	0.11
28	110079	杭银转债	34,918,841.10	0.11
29	110048	福能转债	34,479,369.79	0.11
30	128134	鸿路转债	33,819,379.98	0.11
31	123056	雪榕转债	32,998,327.40	0.10
32	113043	财通转债	32,554,614.97	0.10
33	123049	维尔转债	32,303,449.26	0.10
34	110047	山鹰转债	32,050,766.86	0.10
35	110089	兴发转债	31,208,931.76	0.10
36	127044	蒙娜转债	30,801,110.14	0.10
37	113062	常银转债	29,813,253.10	0.09
38	110086	精工转债	29,421,823.41	0.09

39	113596	城地转债	24,546,195.31	0.08
40	128108	蓝帆转债	23,145,053.43	0.07
41	110080	东湖转债	22,915,713.31	0.07
42	113046	金田转债	20,892,828.64	0.07
43	111007	永和转债	19,812,582.54	0.06
44	123168	惠云转债	18,268,585.43	0.06
45	127026	超声转债	18,030,501.16	0.06
46	127058	科伦转债	17,920,558.02	0.06
47	113657	再22转债	17,769,856.04	0.06
48	110091	合力转债	16,783,955.94	0.05
49	113545	金能转债	16,518,969.41	0.05
50	128048	张行转债	16,262,427.85	0.05
51	127006	敖东转债	15,881,730.63	0.05
52	123115	捷捷转债	15,760,556.02	0.05
53	127067	恒逸转2	15,550,381.13	0.05
54	123076	强力转债	15,495,277.18	0.05
55	127052	西子转债	15,377,393.12	0.05
56	110043	无锡转债	14,891,919.12	0.05
57	127070	大中转债	14,805,439.51	0.05
58	128141	旺能转债	14,277,440.79	0.05
59	110075	南航转债	14,139,462.89	0.04
60	113606	荣泰转债	13,664,908.82	0.04
61	113663	新化转债	12,572,973.29	0.04
62	110073	国投转债	11,488,587.63	0.04
63	110067	华安转债	11,382,413.44	0.04
64	113593	沪工转债	11,144,936.00	0.04
65	123126	瑞丰转债	10,898,325.48	0.03
66	118024	冠宇转债	10,546,740.95	0.03
67	118009	华锐转债	9,945,514.29	0.03
68	113534	鼎胜转债	9,935,372.71	0.03
69	123178	花园转债	9,932,651.59	0.03
70	110062	烽火转债	9,838,420.13	0.03
71	113654	永02转债	9,667,905.28	0.03

72	127073	天赐转债	9,451,471.10	0.03
73	123158	宙邦转债	9,426,175.41	0.03
74	113644	艾迪转债	9,028,515.77	0.03
75	123147	中辰转债	7,962,118.71	0.03
76	127047	帝欧转债	7,867,269.66	0.02
77	128081	海亮转债	7,691,080.51	0.02
78	113569	科达转债	7,567,486.22	0.02
79	113042	上银转债	7,537,733.03	0.02
80	123059	银信转债	7,476,273.92	0.02
81	113048	晶科转债	7,425,384.63	0.02
82	110087	天业转债	7,389,698.51	0.02
83	111000	起帆转债	7,161,591.19	0.02
84	127033	中装转2	6,972,880.09	0.02
85	127043	川恒转债	6,805,702.28	0.02
86	111004	明新转债	6,734,499.24	0.02
87	123176	精测转2	6,593,486.31	0.02
88	111009	盛泰转债	6,590,015.51	0.02
89	113625	江山转债	6,583,577.56	0.02
90	127038	国微转债	6,512,487.39	0.02
91	113637	华翔转债	6,490,770.08	0.02
92	113589	天创转债	6,458,466.78	0.02
93	123169	正海转债	6,437,219.43	0.02
94	128123	国光转债	6,372,850.05	0.02
95	127060	湘佳转债	6,306,632.68	0.02
96	113025	明泰转债	6,279,656.62	0.02
97	127077	华宏转债	6,251,361.40	0.02
98	113648	巨星转债	6,173,938.05	0.02
99	127018	本钢转债	6,052,007.36	0.02
100	118015	芯海转债	5,435,489.35	0.02
101	113653	永22转债	5,357,334.15	0.02
102	123124	晶瑞转2	5,352,568.01	0.02
103	113662	豪能转债	5,156,994.52	0.02
104	123171	共同转债	4,799,101.63	0.02

105	128144	利民转债	4,624,798.52	0.01
106	113640	苏利转债	3,551,701.32	0.01
107	123150	九强转债	3,431,748.75	0.01
108	118017	深科转债	3,266,073.16	0.01
109	111002	特纸转债	3,241,100.27	0.01
110	127063	贵轮转债	3,134,709.72	0.01
111	123092	天壕转债	3,089,026.72	0.01
112	128063	未来转债	3,016,659.49	0.01
113	123133	佩蒂转债	2,815,010.36	0.01
114	113600	新星转债	2,750,199.66	0.01
115	113639	华正转债	2,741,778.16	0.01
116	113632	鹤21转债	2,614,602.17	0.01
117	113610	灵康转债	2,444,606.25	0.01
118	118028	会通转债	2,421,794.60	0.01
119	118011	银微转债	2,152,824.15	0.01
120	127031	洋丰转债	1,813,450.81	0.01
121	128137	洁美转债	1,161,522.49	0.00
122	113649	丰山转债	865,412.98	0.00
123	111011	冠盛转债	574,680.15	0.00
124	118027	宏图转债	348,877.62	0.00
125	123182	广联转债	320,766.55	0.00
126	123157	科蓝转债	288,050.95	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	3,049,708,100. 11	21,547,163,65 6.16	1,305,619,712. 26	2,728,958,162. 87



报告期期间基金总申购份额	438,995,477.1 0	1,819,705,624. 65	196,296,878.6 3	493,458,279.5 4
减：报告期期间基金总赎回份额	664,927,239.5 5	2,653,439,615. 70	190,564,588.5 8	951,484,859.4 7
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	2,823,776,337. 66	20,713,429,66 5.11	1,311,352,002. 31	2,270,931,582. 94

## §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

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
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	66,938,97 4.93	-	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	66,938,97 4.93	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	0.32	-	-

注：报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自级别的份额总额计算。

### 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](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