

# 天弘永利债券型证券投资基金

## 2022年第4季度报告

2022年12月31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01月28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01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10月01日起至2022年12月31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	27,716,589,939.75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	3,065,660,066.05份	20,647,726,623.79份	1,426,394,707.41份	2,576,808,542.50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10月01日 - 2022年12月31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	2,956,176.91	48,729,486.01	3,504,180.79	3,434,800.01
2.本期利润	-3,143,107.55	1,812,543.71	755,211.21	-1,798,006.54
3.加权平均基金份额 本期利润	-0.0010	0.0001	0.0005	-0.0006
4.期末基金资产净 值	3,606,244,311. 39	24,310,088,45 7.66	1,548,186,817. 00	2,726,226,538. 78
5.期末基金份额净 值	1.1763	1.1774	1.0854	1.0580

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	-0.11%	0.22%	-0.02%	0.08%	-0.09%	0.14%
过去六个月	-0.55%	0.18%	1.45%	0.06%	-2.00%	0.12%
过去一年	-1.91%	0.19%	3.30%	0.06%	-5.21%	0.13%
过去三年	24.10%	0.29%	11.78%	0.07%	12.32%	0.22%
过去五年	40.14%	0.26%	26.50%	0.07%	13.64%	0.19%
自基金合同 生效日起至	125.00%	0.20%	81.78%	0.08%	43.22%	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	-0.01%	0.22%	-0.02%	0.08%	0.01%	0.14%
过去六个月	-0.34%	0.19%	1.45%	0.06%	-1.79%	0.13%
过去一年	-1.51%	0.19%	3.30%	0.06%	-4.81%	0.13%
过去三年	25.59%	0.29%	11.78%	0.07%	13.81%	0.22%
过去五年	42.97%	0.26%	26.50%	0.07%	16.47%	0.19%
自基金合同生效日起至今	138.81%	0.20%	81.78%	0.08%	57.03%	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	-0.01%	0.22%	-0.02%	0.08%	0.01%	0.14%
过去六个月	-0.34%	0.19%	1.45%	0.06%	-1.79%	0.13%
过去一年	-1.51%	0.19%	3.30%	0.06%	-4.81%	0.13%
过去三年	25.60%	0.29%	11.78%	0.07%	13.82%	0.22%
过去五年	43.00%	0.26%	26.50%	0.07%	16.50%	0.19%
自基金份额首次确认日起至今	37.81%	0.41%	28.01%	0.07%	9.80%	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	-0.08%	0.22%	-0.02%	0.08%	-0.06%	0.14%

过去六个月	-0.49%	0.19%	1.45%	0.06%	-1.94%	0.13%
过去一年	-1.81%	0.19%	3.30%	0.06%	-5.11%	0.13%
自基金份额 首次确认日 起至今	20.78%	0.30%	8.53%	0.06%	12.25%	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12月31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12月31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年06月	-	8年	男，金融数学硕士。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、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遵规守信情况的说明

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2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

当前位置对权益类资产保持高度乐观。大小盘股票的估值都到了过去10年的偏底部的位置，已经计入了相当程度的悲观预期。而随着疫情防控的放开、地产政策的不断放松，经济有望逐步走出底部。目前权益类资产无论赔率还是胜率角度，都已经非常高。但由于利率可能大概率到了长周期的拐点，转债估值会面临持续的压力，转债的性价比会弱于股票。

在转债资产的布局上，将沿着消费场景再现、经济修复的主线上，挑选安全边际充足、质地优秀的标的进行积极的布局。

2022年4季度政策层面的变化，对市场产生了根本性的影响：在全面恢复正常化后，除了消费、生产、生活等各方面将逐步恢复到正常的状态以外，相应的不确定性风险大幅度降低，这对整个市场的预期和估值体系，都有了根本性的改变。另外，地产政策的改变，对整个经济的走向也产生了根本性的影响：之前所担心的地产和相关金融体系的风险，在政策改变的框架下，得到托底和修复，这将对未来一段时间经济的企稳贡献重要的托底力量。在这两个极为重要变量发生根本性的变化的背景下，我们对市场的判断也由之前的中性和震荡，转为战略性看好权益市场。当然未来大概率还会存在一些反复的情形，包括疫情扩散后的次生问题，以及经济体恢复需要时间和恢复力度强弱的问题等等，但我们认为从中长期维度经济和市场逐步走出阴霾是大概率事件。

但这个过程也相对复杂。我们知道目前国内的经济结构和国际形势，都与以往有较大不同，这对我们的分析框架和理解范式都提出了新的要求。经济中重要的行业目前仍处于困境复苏的状态，但复苏的力度有多强以及稳定性延续性，这些都需要保持跟踪。如果说全面恢复后，经济就能回到之前强劲的状态，我们认为还是存疑。这包括：目前经济运行的库存偏高和需求偏弱，在没有强力拉动的情形下，经济整体要走出“去库存”的周期，还需要一定的时间；另一个是出口目前处于相对弱的状态，过去两年强力的出口对经济有较强的带动作用，而目前出口的走弱以及海外经济下行的不确定性，给出口拉动因素蒙上了一些阴影；地产在政策的支持下，企业主体端会救助，而市场端我们看到在2022年下半年，尤其是断贷事件发酵下，新屋销售环比保持了没有下滑，而二手房的销量也比较稳，加上居民端储蓄率的大幅上升，我们认为居民的购房能力和目前购房的意愿都是有底的，但好转起来能上升多少幅度，还需要再做跟踪和研判，但底部特征已经具备。在这些因素的交织下，我们认为未来一段时间，好的因素和不好的因素交织，可能使得经济复苏的步伐不像我们直接想象的那么直接和线性。

对于市场，我们认为可以更加乐观一些，因为之前我们列为重点风险的几个点，已经有以上两个大的风险得到了改变。资本市场是聪明和领先的，预期领先于现实，未来实体经济的逐步修复过程，将穿插着信心层面和现实层面的交叉互验上升，如果进一步看到居民和企业家信心的改善，居民重新加大支出力度而非储蓄、企业家加大投资和創新都是可以预期的，这将带来经济的重新上行，以及风险偏好的改善。

4季度我们进一步提高了仓位，配置上相对均衡一些。加仓了金融和地产链的相关标的，我们认为在地产政策的转向下，地产企业端的风险得到了释放，而销售端虽然仍然维持低位，但在较大的宏观压力下数据上也表现出来没有继续下滑的迹象，行业或已经在底部状态；而地产问题的改善，也带来金融体系资产端的风险释放，对于地产链和金融行业，未来具备竞争格局上有优势并且能够维持的标的，我们认为现在可以做相对长期的配置考量。此外，经历较长时间的市场下行，已经有较多价值类的标的处于历史估值的低位，而政策的全面转向和经济未来见底回升的预期，也带来这些标的有可能进入困境反转的境地，在这块我们也进行了加仓。而之前我们所持有的一些成长类或者稳定类的标的，我们继续持有，少量做了一些调换，对过去两年预期已经走向高度一致，并且产业趋势有一些变化的地方，我们认为需要更多的跟踪和研究的迭代，包括传统的赛道以及创新。在供需格局，产业竞争格局有可能变化的地步，我们认为需要审慎对待，重点考虑调整后的风险收益比，仓位上注意防范风险。避开过于一致预期，并且在研判的假设上本身存在不确定性的行业和个股。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2022年12月31日，天弘永利债券A基金份额净值为1.1763元，天弘永利债券B基金份额净值为1.1774元，天弘永利债券E基金份额净值为1.0854元，天弘永利债券C基金份额净值为1.0580元。报告期内份额净值增长率天弘永利债券A为-0.11%，同期业绩比较基准增长率为-0.02%；天弘永利债券B为-0.01%，同期业绩比较基准增长率为-0.02%；天弘永利债券E为-0.01%，同期业绩比较基准增长率为-0.02%；天弘永利债券C为-0.08%，同期业绩比较基准增长率为-0.02%。

#### 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	5,098,565,757.27	14.50
	其中：股票	5,098,565,757.27	14.50

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,591,940,987.45	84.13
	其中：债券	29,591,940,987.45	84.13
	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	48,892,872.33	0.14
	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	338,834,395.70	0.96
8	其他资产	95,519,417.16	0.27
9	合计	35,173,753,429.91	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	88,953,237.80	0.28
C	制造业	2,424,482,089.46	7.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	225,704,940.08	0.70
E	建筑业	209,219,733.76	0.65
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	72,149,857.36	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,740,832.00	0.33
J	金融业	1,648,966,677.53	5.12
K	房地产业	235,948,010.20	0.73
L	租赁和商务服务业	71,902,224.08	0.22
M	科学研究和技术服务业	13,498,155.00	0.04
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	5,098,565,757.27	15.84

### 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	600036	招商银行	9,391,073	349,911,379.98	1.09
2	300033	同花顺	3,179,574	313,537,792.14	0.97
3	300059	东方财富	15,584,600	302,341,240.00	0.94
4	300737	科顺股份	16,311,827	205,202,783.66	0.64
5	601318	中国平安	4,362,300	205,028,100.00	0.64
6	601601	中国太保	8,349,577	204,731,628.04	0.64
7	300408	三环集团	6,590,402	202,391,245.42	0.63
8	600039	四川路桥	16,635,848	184,990,629.76	0.57
9	002271	东方雨虹	5,445,834	182,816,647.38	0.57
10	603337	杰克股份	9,361,692	178,246,615.68	0.55

### 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	161,941,054.81	0.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,406,252,136.97	19.90
	其中：政策性金融债	5,241,910,394.51	16.28
4	企业债券	12,596,076,079.52	39.13
5	企业短期融资券	10,150,280.55	0.03
6	中期票据	5,991,639,651.50	18.61
7	可转债（可交换债）	4,277,617,875.57	13.29
8	同业存单	148,263,908.53	0.46
9	其他	-	-

10	合计	29,591,940,987.45	91.93
----	----	-------------------	-------

注:可转债项下包含可交换债71,066,576.81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	8,500,000	864,188,013.70	2.68
2	220220	22国开20	5,700,000	562,097,769.86	1.75
3	170208	17国开08	5,000,000	522,284,246.58	1.62
4	2128035	21华夏银行02	4,700,000	474,208,083.84	1.47
5	185286	22招证G1	4,000,000	407,922,608.20	1.27

### 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,【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;【招商银行股份有限公司】分别于2022年03月21日、2022年09月09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。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 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	2,051,265.96
2	应收证券清算款	62,264,192.81
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,203,958.39
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	95,519,417.16

### 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	304,598,441.52	0.95
2	113050	南银转债	241,776,565.10	0.75
3	113641	华友转债	224,747,100.54	0.70
4	127049	希望转2	209,356,617.48	0.65
5	110053	苏银转债	208,674,770.39	0.65
6	110081	闻泰转债	194,834,264.77	0.61
7	127045	牧原转债	170,458,760.89	0.53
8	127061	美锦转债	149,518,026.17	0.46
9	127022	恒逸转债	145,949,546.75	0.45
10	127032	苏行转债	129,385,159.72	0.40
11	123107	温氏转债	127,390,577.18	0.40
12	127040	国泰转债	104,454,559.91	0.32
13	110072	广汇转债	101,706,941.62	0.32
14	110043	无锡转债	101,503,231.80	0.32
15	113623	凤21转债	88,265,713.43	0.27
16	110085	通22转债	77,471,113.70	0.24
17	113602	景20转债	74,377,696.22	0.23

18	127020	中金转债	73,814,296.52	0.23
19	113054	绿动转债	73,275,162.84	0.23
20	113057	中银转债	71,366,402.79	0.22
21	113055	成银转债	71,355,084.03	0.22
22	132018	G三峡EB1	71,066,576.81	0.22
23	113045	环旭转债	67,263,408.79	0.21
24	110063	鹰19转债	55,684,518.63	0.17
25	128131	崇达转2	54,898,489.78	0.17
26	110075	南航转债	53,113,721.98	0.16
27	128109	楚江转债	47,913,756.92	0.15
28	127027	靖远转债	46,242,465.14	0.14
29	110047	山鹰转债	42,626,682.41	0.13
30	110084	贵燃转债	36,673,320.33	0.11
31	113051	节能转债	34,117,619.94	0.11
32	113056	重银转债	33,764,921.16	0.10
33	123128	首华转债	33,018,959.65	0.10
34	127030	盛虹转债	32,867,949.74	0.10
35	128134	鸿路转债	32,825,560.46	0.10
36	110062	烽火转债	31,987,221.63	0.10
37	123056	雪榕转债	31,849,873.15	0.10
38	123049	维尔转债	29,155,409.26	0.09
39	110086	精工转债	28,474,511.68	0.09
40	113563	柳药转债	27,302,696.91	0.08
41	113596	城地转债	24,146,448.71	0.08
42	128108	蓝帆转债	22,725,474.32	0.07
43	113021	中信转债	21,961,490.41	0.07
44	123077	汉得转债	21,239,259.32	0.07
45	113033	利群转债	20,191,656.84	0.06
46	113046	金田转债	19,964,914.08	0.06
47	113060	浙22转债	19,461,783.44	0.06
48	123131	奥飞转债	17,562,327.34	0.05
49	127026	超声转债	17,282,995.59	0.05
50	127044	蒙娜转债	16,581,129.28	0.05

51	123115	捷捷转债	16,000,101.33	0.05
52	128075	远东转债	14,405,092.76	0.04
53	128141	旺能转债	14,139,103.34	0.04
54	128121	宏川转债	13,661,133.42	0.04
55	110073	国投转债	10,769,928.17	0.03
56	123126	瑞丰转债	10,625,101.36	0.03
57	110067	华安转债	10,588,414.48	0.03
58	127050	麒麟转债	10,541,532.94	0.03
59	123147	中辰转债	9,715,946.14	0.03
60	113606	荣泰转债	9,134,493.37	0.03
61	113573	纵横转债	9,081,900.87	0.03
62	113644	艾迪转债	8,435,173.39	0.03
63	113535	大业转债	8,321,099.83	0.03
64	113048	晶科转债	8,039,380.91	0.02
65	113604	多伦转债	7,635,162.69	0.02
66	113632	鹤21转债	7,534,134.65	0.02
67	110087	天业转债	7,313,300.82	0.02
68	113042	上银转债	7,256,406.10	0.02
69	127033	中装转2	7,214,896.46	0.02
70	123078	飞凯转债	6,613,928.05	0.02
71	123075	贝斯转债	6,348,896.80	0.02
72	113589	天创转债	6,242,472.53	0.02
73	113569	科达转债	5,565,653.30	0.02
74	128123	国光转债	5,414,867.59	0.02
75	128063	未来转债	5,129,726.33	0.02
76	123076	强力转债	4,805,577.27	0.01
77	127047	帝欧转债	4,800,034.02	0.01
78	113025	明泰转债	2,442,345.21	0.01
79	113545	金能转债	1,595,559.40	0.00
80	123059	银信转债	1,035,653.42	0.00
81	113636	甬金转债	632,327.09	0.00
82	113530	大丰转债	559,171.75	0.00
83	127019	国城转债	513,479.05	0.00

84	127024	盈峰转债	385,516.45	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	3,468,350,825.72	24,267,749,184.23	1,953,438,852.59	3,335,394,238.02
报告期期间基金总申购份额	265,125,496.63	1,936,786,094.48	47,803,870.31	851,780,389.37
减：报告期期间基金总赎回份额	667,816,256.30	5,556,808,654.92	574,848,015.49	1,610,366,084.89
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	3,065,660,066.05	20,647,726,623.79	1,426,394,707.41	2,576,808,542.50

## §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A类基金份额、B类基金份额在基金销售机构及直销机构的单笔最低追加申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额，并于2022年11月23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追加申购金额、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](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二三年一月二十八日