

---

# 天弘睿选利率债债券型发起式证券投资基金

## 2024年第2季度报告

2024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:华夏银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月19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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年07月17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2024年04月01日起至2024年06月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	天弘睿选利率债发起式	
基金主代码	012858	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年08月02日	
报告期末基金份额总额	3,999,696,246.46份	
投资目标	本基金在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资人获取稳健回报。	
投资策略	主要投资策略包括：资产配置策略、久期选择、收益率曲线分析、息差策略。	
业绩比较基准	中债-金融债券总全价(总值)指数收益率×80%+银行人民币活期存款利率（税后）×20%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	天弘睿选利率债发起式 A	天弘睿选利率债发起式 C
下属分级基金的交易代码	012858	012859
报告期末下属分级基金的份额总	3,954,870,672.75份	44,825,573.71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(2024年04月01日 - 2024年06月30日)	
	天弘睿选利率债发起式A	天弘睿选利率债发起式C
1.本期已实现收益	6,174,598.85	80,203.60
2.本期利润	34,231,255.38	365,029.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0141	0.0081
4.期末基金资产净值	4,112,998,121.79	46,449,828.13
5.期末基金份额净值	1.0400	1.0362

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

天弘睿选利率债发起式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	1.34%	0.13%	0.69%	0.06%	0.65%	0.07%
过去六个月	3.87%	0.15%	1.15%	0.06%	2.72%	0.09%
过去一年	5.78%	0.12%	1.72%	0.05%	4.06%	0.07%
自基金合同生效日起至今	12.02%	0.08%	3.02%	0.06%	9.00%	0.02%

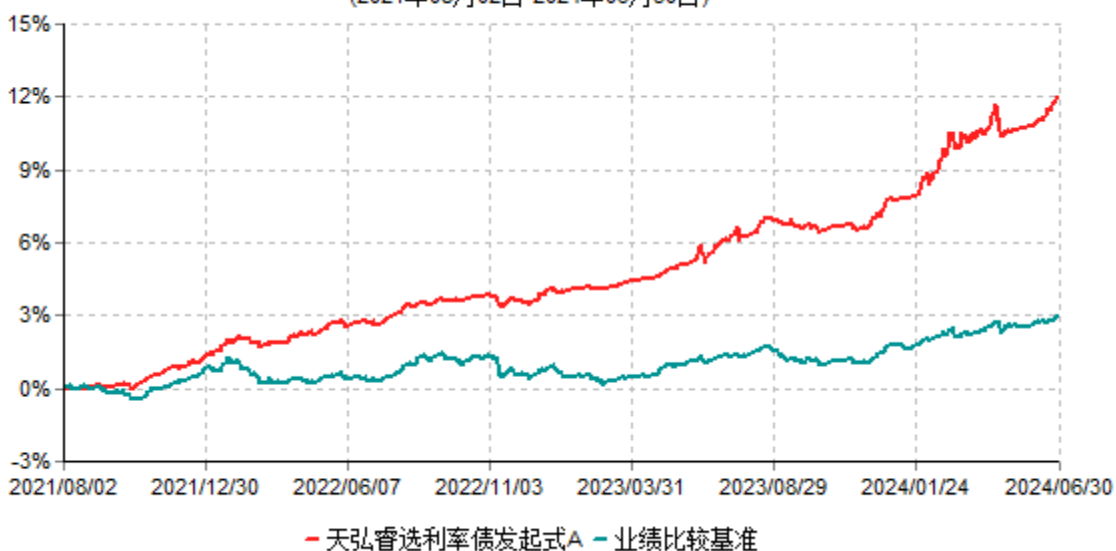
天弘睿选利率债发起式C净值表现

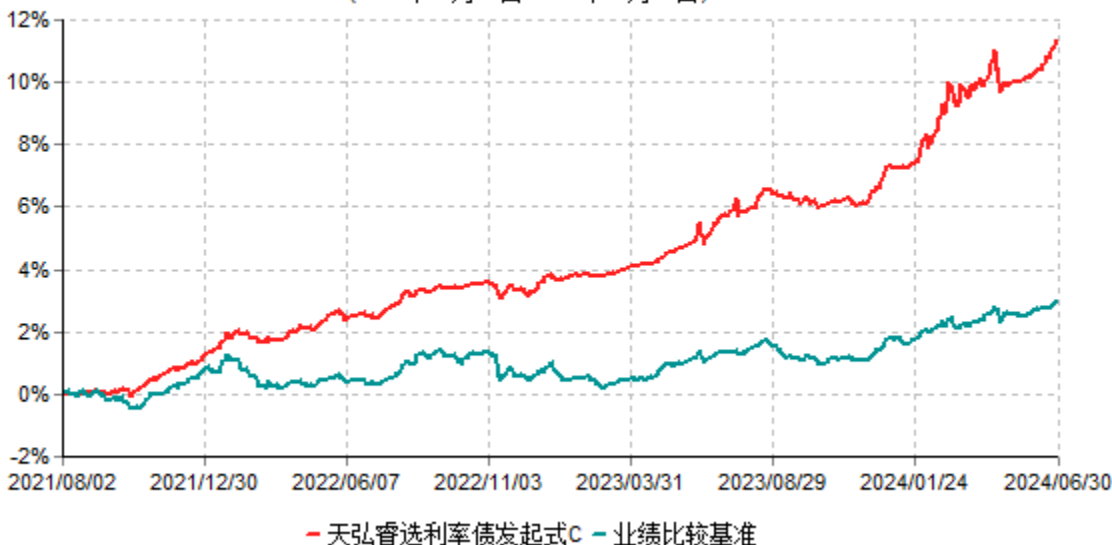
阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	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	1.28%	0.13%	0.69%	0.06%	0.59%	0.07%
过去六个月	3.75%	0.15%	1.15%	0.06%	2.60%	0.09%
过去一年	5.54%	0.12%	1.72%	0.05%	3.82%	0.07%
自基金合同生效日起至今	11.34%	0.08%	3.02%	0.06%	8.32%	0.02%

### 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

天弘睿选利率债发起式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  
(2021年08月02日-2024年06月30日)



天弘睿选利率债发起式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  
(2021年08月02日-2024年06月30日)

注：1、本基金合同于2021年08月02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。

## §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		
彭玮	本基金基金经理	2023年06月	-	7年	男，金融专业硕士。历任渤海证券股份有限公司交易助理、渤海汇金证券资产管理有限公司投资经理助理。2019年7月加盟本公司，历任研究员。

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0次，未发生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

2024年二季度，超长债利率波动较大，更多机会集中在利率曲线的10年及以内。

4-5月，存款搬家至非银金融机构，申购潮导致各类非银主体基金、理财、保险出现了较大的欠配缺口，杠杆率下降导致被动配置力量驱使了中短端利率下行，而超长债由于央行的喊话整体呈现了宽幅震荡行情，在这段时间我们保持了较高的高杠杆和组合久期水平。

而到了6月，由于信贷增速过慢，市场交易降息预期，非银主体的杠杆率回升，同时久期偏好在增加，导致超长债受到追捧，市场的投机情绪在增加，在这段时间我们保持了较高的高杠杆和组合久期水平，跟随市场的趋势交易行情。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2024年06月30日，天弘睿选利率债发起式A基金份额净值为1.0400元，天弘睿选利率债发起式C基金份额净值为1.0362元。报告期内份额净值增长率天弘睿选利率债发起式A为1.34%，同期业绩比较基准增长率为0.69%；天弘睿选利率债发起式C为1.28%，同期业绩比较基准增长率为0.69%。

#### 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	4,526,298,621.11	98.78
	其中：债券	4,526,298,621.11	98.78
	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	1,219,417.00	0.03
8	其他资产	54,719,641.46	1.19
9	合计	4,582,237,679.57	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	1,329,560,019.02	31.96
2	央行票据	-	-

3	金融债券	3,196,738,602.09	76.85
	其中：政策性金融债	3,196,738,602.09	76.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,526,298,621.11	108.82

### 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	240203	24国开03	7,500,000	765,577,049.18	18.41
2	240210	24国开10	5,000,000	504,302,739.73	12.12
3	2400001	24特别国债01	3,900,000	403,116,929.35	9.69
4	230208	23国开08	3,900,000	398,562,263.01	9.58
5	240205	24国开05	2,500,000	259,843,784.15	6.25

**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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	54,719,641.46
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	54,719,641.46

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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

	天弘睿选利率债发起式 A	天弘睿选利率债发起式 C
报告期期初基金份额总额	1,926,314,008.75	56,829,960.81
报告期期间基金总申购份额	2,362,975,140.11	72,163,912.56
减：报告期期间基金总赎回份额	334,418,476.11	84,168,299.66
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	3,954,870,672.75	44,825,573.71

## §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

	天弘睿选利率债发起式A	天弘睿选利率债发起式C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
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	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.13	11.15

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.25%	10,000,000.00	0.25%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.25%	10,000,000.00	0.25%	-

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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。

### 9.2 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。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘睿选利率债债券型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘睿选利率债债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、天弘睿选利率债债券型发起式证券投资基金托管协议
- 4、天弘睿选利率债债券型发起式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

### 10.2 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

### 10.3 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  
二〇二四年七月十九日