

---

# 天弘永利债券型证券投资基金

## 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:兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	19,085,087,484.32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	1,924,051,851.17份	14,636,950,058.46份	788,729,044.70份	1,735,356,529.99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(2024年04月01日 - 2024年06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	4,513,664.62	51,498,998.60	2,456,775.58	4,345,502.70
2.本期利润	22,998,083.37	202,245,317.21	11,737,166.50	15,784,344.06
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0120	0.0137	0.0141	0.0093
4.期末基金资产净 值	2,302,534,963. 29	17,556,975,383. 84	872,218,835.7 0	1,868,370,184. 97
5.期末基金份额净 值	1.1967	1.1995	1.1059	1.0766

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	1.06%	0.17%	1.74%	0.07%	-0.68%	0.10%
过去六个月	2.26%	0.21%	3.76%	0.07%	-1.50%	0.14%
过去一年	1.80%	0.18%	5.92%	0.06%	-4.12%	0.12%
过去三年	10.74%	0.21%	15.55%	0.05%	-4.81%	0.16%
过去五年	36.56%	0.26%	24.82%	0.06%	11.74%	0.20%
自基金合同 生效日起至	133.66%	0.20%	97.62%	0.08%	36.04%	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	1.16%	0.17%	1.74%	0.07%	-0.58%	0.10%
过去六个月	2.46%	0.21%	3.76%	0.07%	-1.30%	0.14%
过去一年	2.22%	0.18%	5.92%	0.06%	-3.70%	0.12%
过去三年	12.08%	0.21%	15.55%	0.05%	-3.47%	0.16%
过去五年	39.31%	0.26%	24.82%	0.06%	14.49%	0.20%
自基金合同生效日起至今	149.47%	0.20%	97.62%	0.08%	51.85%	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	1.16%	0.17%	1.74%	0.07%	-0.58%	0.10%
过去六个月	2.46%	0.21%	3.76%	0.07%	-1.30%	0.14%
过去一年	2.22%	0.18%	5.92%	0.06%	-3.70%	0.12%
过去三年	12.09%	0.21%	15.55%	0.05%	-3.46%	0.16%
过去五年	39.33%	0.26%	24.82%	0.06%	14.51%	0.20%
自基金份额首次确认日起至至今	43.97%	0.38%	39.16%	0.07%	4.81%	0.31%

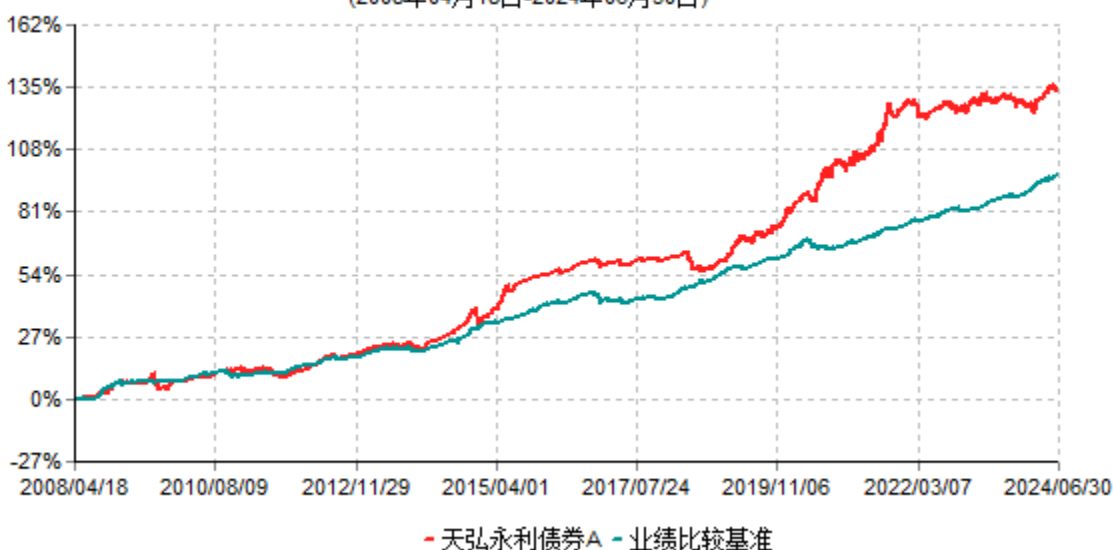
## 天弘永利债券C净值表现

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	1.08%	0.17%	1.74%	0.07%	-0.66%	0.10%

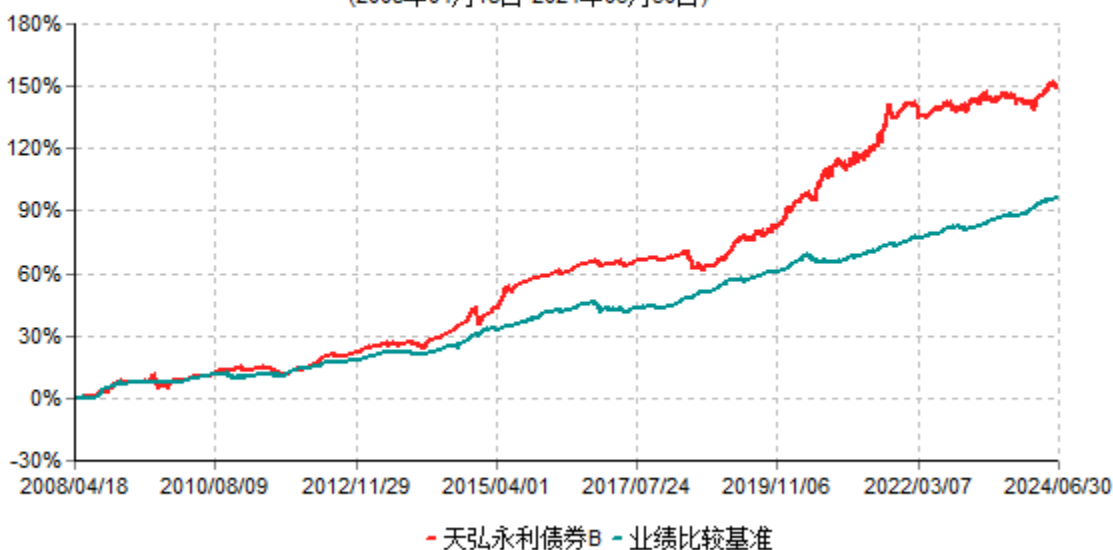
过去六个月	2.30%	0.21%	3.76%	0.07%	-1.46%	0.14%
过去一年	1.90%	0.18%	5.92%	0.06%	-4.02%	0.12%
过去三年	11.07%	0.22%	15.55%	0.05%	-4.48%	0.17%
自基金份额 首次确认日 起至今	25.61%	0.26%	17.99%	0.06%	7.62%	0.20%

### 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-2024年06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-2024年06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-2024年06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-2024年06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	-	9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	-	10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	-	14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	-	15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、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《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

市场对经济的预期相对不乐观。在股票上，反映在对水电、运营商、大盘红利型资产的极致抱团；在债券上，反映在对长久期利率债的追逐；在渠道端，反映在对任何低权益含量产品的热衷。

这种一致预期往往对市场并不有利。因为在资本市场中最好的预测方式并非是线性的，而是带着周期性的视角，一个宏大叙事深入人心、抵达顶点，往往是衰落的开始。我们认为资本市场忽视了很多经济改善的事实，以及政策层面上的努力，即便这些改善目前表现温和，但不可否认的是政策层面对于打破经济、尤其是地产负向循环的决心。

在转债资产中，市场似乎重复了每一轮信用危机+中小盘股票下跌的韵脚，这些故事在2018年，2020年12月都发生过。与前几轮不同的是，在目前的监管环境下，股票的退市风险要更大，因此我们各个组合做了一些梳理和风险的防范。但我们认为市场泥沙俱下并不合理，没有信用风险、退市风险的中小盘低价转债，依然是值得我们在里面进行定价和投资的。长期来看，这部分转债的alpha会因为环境的变化而有所削弱，但是并没有消失。现在是需要里面积极进行挖掘和定价的时刻。二季度债市延续牛市行情，操作上我们以哑铃型策略为主，底仓部分维持中性偏高久期水平，同时利用长久期利率债增加波段收益。宏观上出口的相对强势得到了数据的验证，但内需的弱势也超出了预期；房地产相关政策出台后我们认为政策持续向好的趋势将能够保持，在政策的累加效



应下，经济底应该能够看到。在资产配置上我们保持了股票较高的仓位，在5月略降低仓位；在6月的市场回撤中，基于对基本面的判断我们持续加仓股票至高水平；在配置结构方向上，在观察到海外的贸易摩擦可能加剧的情况下，将配置方向开始逐步向内需转，包括流通、军工、消费、医药等运营类资产，整体组合更加均衡；但6月的回撤超出了我们的预期，初步判断金融抑制的情况在股票市场已经发生，导致市场流动性匮乏，后续我们将通过进一步的研究来回答这个问题。在债券的配置上，我们关注到市场始终面临资产供给不足的情况，在短端利率较高的情况下，我们认为债券整体没有实质性风险，保持了中性的配置。在可转债上，在观察到监管环境变化引发中介机构行为变化后，我们系统降低了可转债投资敞口，并设立一定的风险机制控制持仓质量，整体控制住了风险。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2024年06月30日，天弘永利债券A基金份额净值为1.1967元，天弘永利债券B基金份额净值为1.1995元，天弘永利债券E基金份额净值为1.1059元，天弘永利债券C基金份额净值为1.0766元。报告期内份额净值增长率天弘永利债券A为1.06%，同期业绩比较基准增长率为1.74%；天弘永利债券B为1.16%，同期业绩比较基准增长率为1.74%；天弘永利债券E为1.16%，同期业绩比较基准增长率为1.74%；天弘永利债券C为1.08%，同期业绩比较基准增长率为1.74%。

#### 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	3,351,018,099.16	12.85
	其中：股票	3,351,018,099.16	12.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,686,093,500.39	83.19
	其中：债券	21,686,093,500.39	83.19
	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	605,145,841.11	2.32

	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	348,606,191.23	1.34
8	其他资产	77,926,259.31	0.30
9	合计	26,068,789,891.20	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	259,507,824.40	1.15
C	制造业	1,915,734,170.07	8.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	178,518,753.00	0.79
F	批发和零售业	311,377,898.12	1.38
G	交通运输、仓储和邮政业	279,623,056.80	1.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	103,592,849.85	0.46
J	金融业	85,912,850.88	0.38
K	房地产业	25,352,914.62	0.11
L	租赁和商务服务业	65,643,738.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	125,754,043.42	0.56
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	3,351,018,099.16	14.83

## 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	600970	中材国际	14,802,550	178,518,753.00	0.79
2	603337	杰克股份	6,564,076	172,766,480.32	0.76
3	600998	九州通	34,083,899	166,329,427.12	0.74
4	300408	三环集团	5,591,902	163,227,619.38	0.72
5	000680	山推股份	17,269,392	160,087,263.84	0.71
6	002468	申通快递	17,484,539	146,870,127.60	0.65
7	600887	伊利股份	5,134,231	132,668,529.04	0.59
8	002833	弘亚数控	7,208,651	131,485,794.24	0.58
9	601899	紫金矿业	7,381,900	129,699,983.00	0.57
10	300416	苏试试验	9,778,697	125,754,043.42	0.56

## 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	508,478,384.94	2.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,786,852,009.62	34.45
	其中：政策性金融债	3,079,121,297.83	13.62
4	企业债券	8,372,916,920.22	37.05
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,904,324,971.78	12.85
7	可转债（可交换债）	2,113,521,213.83	9.35
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,686,093,500.39	95.96

## 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	240210	24国开10	9,700,000	978,347,315.07	4.33

2	210316	21进出16	8,500,000	903,764,590.16	4.00
3	170208	17国开08	4,300,000	447,633,524.59	1.98
4	2128021	21工商银行永续 债01	4,100,000	426,046,007.12	1.89
5	2028051	20浦发银行永续 债	3,900,000	415,523,688.52	1.84

**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，【中国农业银行股份有限公司】**分别于2023年08月15日、2023年11月16日收到国家金融监督管理总局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	1,089,170.10
2	应收证券清算款	45,426,059.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,411,029.80
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	77,926,259.31

#### 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	127061	美锦转债	180,758,956.40	0.80
2	111010	立昂转债	159,400,488.81	0.71
3	127022	恒逸转债	127,760,719.18	0.57
4	113050	南银转债	125,477,296.47	0.56
5	127049	希望转2	96,257,395.07	0.43
6	110081	闻泰转债	62,320,447.76	0.28
7	113054	绿动转债	54,103,435.77	0.24
8	113055	成银转债	46,599,320.55	0.21
9	113641	华友转债	45,660,156.17	0.20
10	113045	环旭转债	45,139,846.03	0.20
11	118022	锂科转债	43,680,386.82	0.19
12	127044	蒙娜转债	42,501,386.49	0.19
13	128131	崇达转2	34,903,678.50	0.15
14	110085	通22转债	29,456,113.32	0.13
15	123190	道氏转02	29,032,017.68	0.13
16	110079	杭银转债	28,995,004.94	0.13
17	113545	金能转债	28,939,661.43	0.13
18	113062	常银转债	25,934,020.28	0.11
19	127052	西子转债	25,763,857.79	0.11
20	128074	游族转债	25,416,978.63	0.11
21	123076	强力转债	21,859,287.67	0.10
22	111004	明新转债	21,397,285.94	0.09
23	127085	韵达转债	19,818,182.47	0.09
24	128134	鸿路转债	18,205,509.59	0.08
25	123115	捷捷转债	17,414,172.31	0.08
26	113056	重银转债	17,353,468.49	0.08
27	127020	中金转债	16,515,878.60	0.07

28	128117	道恩转债	16,161,023.22	0.07
29	118024	冠宇转债	15,550,029.85	0.07
30	127070	大中转债	15,327,747.30	0.07
31	128048	张行转债	14,565,176.16	0.06
32	113043	财通转债	14,450,141.10	0.06
33	113618	美诺转债	13,350,683.72	0.06
34	123180	浙矿转债	13,226,706.20	0.06
35	123169	正海转债	13,146,390.84	0.06
36	118039	煜邦转债	13,027,193.15	0.06
37	123132	回盛转债	12,915,765.93	0.06
38	128116	瑞达转债	12,626,863.70	0.06
39	110076	华海转债	12,613,074.46	0.06
40	127026	超声转债	12,299,536.99	0.05
41	113606	荣泰转债	12,256,441.10	0.05
42	113625	江山转债	12,013,779.06	0.05
43	118032	建龙转债	11,809,891.50	0.05
44	118011	银微转债	11,704,601.74	0.05
45	123193	海能转债	11,601,323.29	0.05
46	113666	爱玛转债	11,413,027.40	0.05
47	113653	永22转债	11,180,327.51	0.05
48	128109	楚江转债	11,082,652.06	0.05
49	113670	金23转债	10,752,654.32	0.05
50	123124	晶瑞转2	10,316,642.16	0.05
51	111009	盛泰转债	10,191,163.35	0.05
52	110089	兴发转债	10,114,113.70	0.04
53	123168	惠云转债	9,529,138.36	0.04
54	123120	隆华转债	9,367,006.52	0.04
55	127067	恒逸转2	9,267,891.37	0.04
56	123234	中能转债	8,647,883.84	0.04
57	113655	欧22转债	8,640,931.51	0.04
58	113644	艾迪转债	8,612,701.37	0.04
59	127030	盛虹转债	8,584,164.38	0.04
60	113679	芯能转债	8,497,845.48	0.04

61	123154	火星转债	8,496,931.51	0.04
62	113046	金田转债	8,330,564.38	0.04
63	111016	神通转债	8,300,841.10	0.04
64	128108	蓝帆转债	8,198,472.33	0.04
65	110077	洪城转债	8,135,761.13	0.04
66	113649	丰山转债	7,852,701.37	0.03
67	123122	富瀚转债	7,827,680.00	0.03
68	113654	永02转债	7,138,613.42	0.03
69	123059	银信转债	7,088,638.36	0.03
70	127060	湘佳转债	6,962,078.63	0.03
71	113636	甬金转债	6,834,041.10	0.03
72	128066	亚泰转债	6,564,789.04	0.03
73	110087	天业转债	6,531,202.60	0.03
74	123151	康医转债	6,519,238.68	0.03
75	118014	高测转债	6,509,859.23	0.03
76	123174	精锻转债	6,449,942.47	0.03
77	123178	花园转债	6,189,910.96	0.03
78	113593	沪工转债	6,165,747.85	0.03
79	123171	共同转债	5,898,164.38	0.03
80	128063	未来转债	5,883,040.03	0.03
81	128125	华阳转债	5,719,824.00	0.03
82	118010	XD洁特转	5,640,655.74	0.02
83	123104	卫宁转债	5,353,422.26	0.02
84	123159	崧盛转债	5,243,977.13	0.02
85	127051	博杰转债	5,235,304.12	0.02
86	128105	长集转债	5,135,372.60	0.02
87	127059	永东转2	4,838,649.56	0.02
88	123126	瑞丰转债	4,788,185.24	0.02
89	127045	牧原转债	4,733,973.70	0.02
90	123082	北陆转债	4,681,939.22	0.02
91	127094	红墙转债	4,632,055.39	0.02
92	123144	裕兴转债	4,620,376.71	0.02
93	127041	弘亚转债	4,608,235.62	0.02

94	113647	禾丰转债	4,503,315.95	0.02
95	123088	威唐转债	4,475,646.03	0.02
96	127042	嘉美转债	4,450,279.05	0.02
97	110094	众和转债	4,190,926.63	0.02
98	123165	回天转债	4,080,725.11	0.02
99	113657	再22转债	4,001,654.79	0.02
100	118029	富淼转债	3,982,563.21	0.02
101	128097	奥佳转债	3,788,784.90	0.02
102	123179	立高转债	3,628,262.50	0.02
103	128124	科华转债	3,481,004.94	0.02
104	123039	开润转债	3,452,180.55	0.02
105	118012	微芯转债	3,390,742.19	0.02
106	123063	大禹转债	3,363,704.38	0.01
107	127078	优彩转债	3,348,350.96	0.01
108	113542	好客转债	3,258,830.96	0.01
109	128081	海亮转债	3,255,175.07	0.01
110	113643	风语转债	3,217,643.84	0.01
111	113624	正川转债	3,199,000.29	0.01
112	118015	芯海转债	3,186,855.24	0.01
113	123214	东宝转债	3,153,008.22	0.01
114	127077	华宏转债	3,139,359.37	0.01
115	118005	天奈转债	2,996,691.78	0.01
116	123233	凯盛转债	2,966,738.53	0.01
117	128121	宏川转债	2,840,437.04	0.01
118	123093	金陵转债	2,745,496.74	0.01
119	127062	垒知转债	2,707,044.79	0.01
120	128141	旺能转债	2,290,487.67	0.01
121	123183	海顺转债	2,255,541.44	0.01
122	123109	昌红转债	2,185,923.74	0.01
123	113605	大参转债	2,147,169.86	0.01
124	113584	家悦转债	2,124,051.51	0.01
125	123191	智尚转债	1,961,692.95	0.01
126	113650	博22转债	1,668,227.00	0.01



127	128053	尚荣转债	1,076,505.48	0.00
128	123185	能辉转债	1,028,006.58	0.00
129	110067	华安转债	671,035.34	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	1,897,895,500.91	14,577,485.276.09	894,168,168.27	1,470,353,250.37
报告期期间基金总申购份额	337,616,556.53	2,076,226,318.96	63,752,357.57	971,556,424.08
减：报告期期间基金总赎回份额	311,460,206.27	2,016,761,536.59	169,191,481.14	706,553,144.46
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	1,924,051,851.17	14,636,950,058.46	788,729,044.70	1,735,356,529.99

## §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	-	66,938,974.93	-	-
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（%）	-	0.46	-	-

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，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](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