
天弘永利债券型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024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:2024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2024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2024年07月01日起至2024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	16,872,628,823.78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	1,620,018,381.15份	13,055,454,054.58份	714,134,137.85份	1,483,022,250.20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07月01日 - 2024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	-10,106,832.91	-63,452,195.64	-3,174,857.81	-7,659,051.25
2.本期利润	27,476,402.77	254,812,383.18	12,932,091.34	23,321,105.43
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0154	0.0183	0.0173	0.0152
4.期末基金资产净 值	1,970,613,335. 12	15,933,599,266. 61	803,549,045.4 1	1,623,686,616. 47
5.期末基金份额净 值	1.2164	1.2205	1.1252	1.0948

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	1.65%	0.29%	0.90%	0.10%	0.75%	0.19%
过去六个月	2.72%	0.24%	2.65%	0.09%	0.07%	0.15%
过去一年	3.20%	0.22%	6.15%	0.07%	-2.95%	0.15%
过去三年	6.44%	0.20%	14.69%	0.06%	-8.25%	0.14%
过去五年	38.09%	0.26%	24.21%	0.07%	13.88%	0.19%
自基金合同生效日起至	137.51%	0.20%	99.39%	0.08%	38.12%	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	1.75%	0.29%	0.90%	0.10%	0.85%	0.19%
过去六个月	2.93%	0.24%	2.65%	0.09%	0.28%	0.15%
过去一年	3.62%	0.22%	6.15%	0.07%	-2.53%	0.15%
过去三年	7.72%	0.20%	14.69%	0.06%	-6.97%	0.14%
过去五年	40.88%	0.26%	24.21%	0.07%	16.67%	0.19%
自基金合同生效日起至今	153.84%	0.20%	99.39%	0.08%	54.45%	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	1.75%	0.29%	0.90%	0.10%	0.85%	0.19%
过去六个月	2.93%	0.24%	2.65%	0.09%	0.28%	0.15%
过去一年	3.62%	0.22%	6.15%	0.07%	-2.53%	0.15%
过去三年	7.72%	0.20%	14.69%	0.06%	-6.97%	0.14%
过去五年	40.89%	0.26%	24.21%	0.07%	16.68%	0.19%
自基金份额首次确认日起至今	46.48%	0.37%	40.40%	0.07%	6.08%	0.30%

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	1.69%	0.29%	0.90%	0.10%	0.79%	0.19%

过去六个月	2.79%	0.24%	2.65%	0.09%	0.14%	0.15%
过去一年	3.32%	0.22%	6.15%	0.07%	-2.83%	0.15%
过去三年	6.77%	0.20%	14.69%	0.06%	-7.92%	0.14%
自基金份额首次确认日起至今	27.73%	0.27%	19.05%	0.06%	8.68%	0.21%

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-2024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-2024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-2024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	2024年09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	2024年08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、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、宏观研究部部门总经理等。

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

Q3经济低迷、市场信心继续走弱，这是在去杠杆进程中最痛苦的时刻，唯有政策可以阻断悲观的循环。我们相信物极必反，坚持了此前的投资思路。9月底的政策转变，我们认为有效针对经济运行痛点、缓释了风险、为经济的下行设置了底线，改变幅度但不改变方向，故投资思路没有显著变化。我们保持了股票配置比例，集中在一带一路、消费、流通、军工等行业；经过上涨后，可转债期权尚可，小幅提高了可转债配置比例；对于债券类资产，我们继续保持中性观点，我们不认为利率有显著的风险，可以根据价值进行逆向投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2024年09月30日，天弘永利债券A基金份额净值为1.2164元，天弘永利债券B基金份额净值为1.2205元，天弘永利债券E基金份额净值为1.1252元，天弘永利债券C基金份额净值为1.0948元。报告期内份额净值增长率天弘永利债券A为1.65%，同期业绩比较基准增长率为0.90%；天弘永利债券B为1.75%，同期业绩比较基准增长率为0.90%；天弘永利债券E为1.75%，同期业绩比较基准增长率为0.90%；天弘永利债券C为1.69%，同期业绩比较基准增长率为0.90%。

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	3,272,308,883.41	13.22
	其中：股票	3,272,308,883.41	13.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,569,450,365.97	83.10
	其中：债券	20,569,450,365.97	83.10
	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	253,500,000.00	1.02
	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	242,363,844.04	0.98
8	其他资产	413,721,750.87	1.67
9	合计	24,751,344,844.29	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	265,634,411.00	1.31
C	制造业	1,818,157,047.66	8.94
D	电力、热力、燃气及水 生产和供应业	-	-
E	建筑业	165,728,225.00	0.82
F	批发和零售业	287,557,097.86	1.41
G	交通运输、仓储和邮政	321,194,820.47	1.58

	业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	92,398,023.50	0.45
J	金融业	101,298,131.12	0.50
K	房地产业	23,193,474.95	0.11
L	租赁和商务服务业	76,584,361.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	120,563,290.85	0.59
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	3,272,308,883.41	16.09

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	002468	申通快递	17,484,539	201,596,734.67	0.99
2	600998	九州通	32,522,799	186,680,866.26	0.92
3	603337	杰克股份	5,966,776	167,785,741.12	0.83
4	600970	中材国际	14,411,150	165,728,225.00	0.82
5	601899	紫金矿业	8,543,700	154,982,718.00	0.76
6	000680	山推股份	17,269,392	144,890,198.88	0.71
7	600887	伊利股份	4,949,631	143,885,773.17	0.71
8	600298	安琪酵母	3,938,400	143,436,528.00	0.71
9	002179	中航光电	3,251,934	141,589,206.36	0.70
10	300408	三环集团	3,743,070	138,867,897.00	0.68

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	689,654,709.89	3.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,466,277,457.68	36.72
	其中：政策性金融债	2,862,206,023.96	14.08
4	企业债券	6,290,842,180.27	30.94
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	3,546,770,307.79	17.44
7	可转债（可交换债）	2,575,905,710.34	12.67
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,569,450,365.97	101.17

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	877,045,136.99	4.31
2	230210	23国开10	6,900,000	727,810,865.75	3.58
3	240420	24农发20	5,000,000	504,954,109.59	2.48
4	2128021	21工商银行永续债01	4,100,000	426,844,035.62	2.10
5	185286	22招证G1	4,000,000	407,431,605.48	2.00

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】于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	967,147.16
2	应收证券清算款	257,019,923.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	155,734,680.59
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	413,721,750.87

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	111010	立昂转债	169,048,715.11	0.83
2	127061	美锦转债	157,206,147.39	0.77
3	113050	南银转债	131,989,257.53	0.65
4	113060	浙22转债	82,032,379.74	0.40
5	110081	闻泰转债	71,517,366.70	0.35
6	127044	蒙娜转债	70,417,889.08	0.35
7	127070	大中转债	59,744,280.82	0.29
8	127022	恒逸转债	57,431,917.81	0.28
9	113054	绿动转债	47,068,508.22	0.23
10	113064	东材转债	44,912,319.89	0.22
11	118022	锂科转债	44,037,383.61	0.22
12	118024	冠宇转债	39,873,282.48	0.20

13	128131	崇达转2	38,654,628.87	0.19
14	110085	通22转债	32,834,535.30	0.16
15	113641	华友转债	31,238,400.00	0.15
16	113545	金能转债	30,650,717.53	0.15
17	127049	希望转2	30,360,256.29	0.15
18	113055	成银转债	28,361,357.26	0.14
19	128074	游族转债	27,976,267.12	0.14
20	123115	捷捷转债	27,049,443.57	0.13
21	123169	正海转债	25,906,278.11	0.13
22	123208	孩王转债	25,679,123.29	0.13
23	123120	隆华转债	24,572,521.96	0.12
24	123193	海能转债	24,316,661.75	0.12
25	123233	凯盛转债	23,089,856.36	0.11
26	111017	蓝天转债	22,809,226.03	0.11
27	123180	浙矿转债	20,613,811.61	0.10
28	127026	超声转债	19,588,758.90	0.10
29	123157	科蓝转债	18,899,416.44	0.09
30	127073	天赐转债	18,734,396.34	0.09
31	123076	强力转债	18,620,624.66	0.09
32	110077	洪城转债	18,586,232.88	0.09
33	127078	优彩转债	18,326,025.23	0.09
34	127020	中金转债	18,298,500.00	0.09
35	118032	建龙转债	18,133,440.51	0.09
36	118011	银微转债	17,620,738.69	0.09
37	111014	李子转债	17,607,389.04	0.09
38	113615	金诚转债	16,682,684.93	0.08
39	128109	楚江转债	16,664,508.64	0.08
40	127085	韵达转债	16,452,250.68	0.08
41	128117	道恩转债	16,138,048.55	0.08
42	128063	未来转债	15,776,024.59	0.08
43	113618	美诺转债	15,585,602.27	0.08
44	123179	立高转债	14,638,460.13	0.07
45	118039	煜邦转债	14,285,960.00	0.07

46	118043	福立转债	14,221,564.38	0.07
47	113644	艾迪转债	12,903,121.81	0.06
48	118009	华锐转债	12,855,238.36	0.06
49	128116	瑞达转债	12,817,703.94	0.06
50	123165	回天转债	12,618,695.66	0.06
51	111004	明新转债	12,413,112.33	0.06
52	113606	荣泰转债	12,279,812.33	0.06
53	113058	友发转债	12,057,547.95	0.06
54	113021	中信转债	11,988,986.30	0.06
55	127055	精装转债	11,910,438.36	0.06
56	113632	鹤21转债	11,899,698.63	0.06
57	113625	江山转债	11,832,487.65	0.06
58	111016	神通转债	11,294,809.73	0.06
59	123222	博俊转债	11,197,473.18	0.06
60	113655	欧22转债	11,177,767.81	0.05
61	128142	新乳转债	11,165,356.16	0.05
62	113648	巨星转债	10,935,849.32	0.05
63	123151	康医转债	10,871,849.06	0.05
64	127075	百川转2	10,740,027.40	0.05
65	127051	博杰转债	10,614,092.98	0.05
66	113627	太平转债	10,515,643.84	0.05
67	110067	华安转债	10,474,642.53	0.05
68	113653	永22转债	10,473,772.53	0.05
69	123154	火星转债	10,316,493.15	0.05
70	123059	银信转债	10,311,109.30	0.05
71	113670	金23转债	10,261,070.79	0.05
72	127030	盛虹转债	10,256,452.06	0.05
73	123124	晶瑞转2	10,208,945.71	0.05
74	110087	天业转债	10,039,150.69	0.05
75	113679	芯能转债	9,812,888.36	0.05
76	110079	杭银转债	9,728,736.44	0.05
77	127067	恒逸转2	9,639,637.51	0.05
78	110076	华海转债	9,579,647.38	0.05

79	127086	恒邦转债	9,547,785.21	0.05
80	123234	中能转债	9,301,510.14	0.05
81	123126	瑞丰转债	9,045,678.79	0.04
82	128081	海亮转债	8,951,903.56	0.04
83	111018	华康转债	8,881,819.18	0.04
84	123109	昌红转债	8,788,284.37	0.04
85	113682	益丰转债	8,546,855.36	0.04
86	123230	金钟转债	8,520,464.66	0.04
87	113643	风语转债	8,412,515.07	0.04
88	123104	卫宁转债	8,406,031.85	0.04
89	118030	睿创转债	8,361,307.87	0.04
90	113043	财通转债	8,209,360.27	0.04
91	113649	丰山转债	8,138,432.88	0.04
92	118012	微芯转债	7,838,001.64	0.04
93	123229	艾录转债	7,618,897.14	0.04
94	123174	精锻转债	7,531,990.41	0.04
95	123178	花园转债	7,364,342.47	0.04
96	118013	道通转债	7,068,978.08	0.03
97	123160	泰福转债	7,015,877.40	0.03
98	123082	北陆转债	7,012,096.70	0.03
99	123190	道氏转02	6,996,778.08	0.03
100	113647	禾丰转债	6,974,454.79	0.03
101	113045	环旭转债	6,930,072.33	0.03
102	113636	甬金转债	6,855,720.00	0.03
103	113623	凤21转债	6,826,117.81	0.03
104	113674	华设转债	6,809,175.90	0.03
105	118025	奕瑞转债	6,763,790.14	0.03
106	128066	亚泰转债	6,727,684.93	0.03
107	128144	利民转债	6,640,142.47	0.03
108	123240	楚天转债	6,495,586.85	0.03
109	118014	高测转债	6,453,795.02	0.03
110	113631	皖天转债	6,425,001.37	0.03
111	113605	大参转债	6,378,657.53	0.03

112	127105	龙星转债	6,149,764.93	0.03
113	127041	弘亚转债	5,964,815.07	0.03
114	123191	智尚转债	5,938,627.40	0.03
115	123237	佳禾转债	5,923,851.32	0.03
116	128121	宏川转债	5,877,942.94	0.03
117	113676	荣23转债	5,812,928.77	0.03
118	123119	康泰转2	5,784,821.92	0.03
119	128125	华阳转债	5,775,616.80	0.03
120	127079	华亚转债	5,680,002.74	0.03
121	123168	惠云转债	5,350,015.07	0.03
122	127059	永东转2	5,176,787.67	0.03
123	123159	崧盛转债	5,130,653.21	0.03
124	113680	丽岛转债	5,113,013.70	0.03
125	123172	漱玉转债	5,065,890.41	0.02
126	128097	奥佳转债	4,878,462.10	0.02
127	123226	中富转债	4,849,736.99	0.02
128	127088	赫达转债	4,592,404.40	0.02
129	127062	垒知转债	4,557,731.38	0.02
130	123211	阳谷转债	4,528,093.15	0.02
131	123088	威唐转债	4,510,164.38	0.02
132	127042	嘉美转债	4,475,128.34	0.02
133	127087	星帅转2	4,068,630.64	0.02
134	113657	XD再22转	3,994,175.34	0.02
135	118035	国力转债	3,964,465.75	0.02
136	118029	富淼转债	3,924,154.65	0.02
137	127068	顺博转债	3,764,783.56	0.02
138	111009	盛泰转债	3,726,778.08	0.02
139	123039	开润转债	3,494,893.97	0.02
140	123187	超达转债	3,476,901.37	0.02
141	127090	兴瑞转债	3,448,584.87	0.02
142	123133	佩蒂转债	3,384,008.22	0.02
143	123236	家联转债	3,363,121.64	0.02
144	123217	富仕转债	3,317,920.27	0.02

145	118033	华特转债	3,300,078.08	0.02
146	113624	正川转债	3,274,978.83	0.02
147	123197	光力转债	3,240,060.00	0.02
148	113661	福22转债	3,205,674.25	0.02
149	123214	东宝转债	3,167,938.36	0.02
150	118015	芯海转债	3,110,981.10	0.02
151	118005	天奈转债	3,005,741.10	0.01
152	127038	国微转债	2,844,468.66	0.01
153	127094	红墙转债	2,812,916.42	0.01
154	127060	湘佳转债	2,774,979.45	0.01
155	113656	嘉诚转债	2,548,565.07	0.01
156	111007	永和转债	2,545,568.53	0.01
157	127072	博实转债	2,381,724.60	0.01
158	123078	飞凯转债	2,334,052.05	0.01
159	123152	润禾转债	2,331,787.40	0.01
160	123212	立中转债	2,268,046.58	0.01
161	123183	海顺转债	2,239,143.33	0.01
162	111005	富春转债	2,200,583.56	0.01
163	123163	金沃转债	2,173,801.10	0.01
164	118036	力合转债	2,161,682.19	0.01
165	123085	万顺转2	2,129,931.51	0.01
166	113584	家悦转债	2,128,110.69	0.01
167	123132	回盛转债	1,952,224.66	0.01
168	113659	莱克转债	1,796,474.86	0.01
169	123093	金陵转债	1,766,629.93	0.01
170	113638	台21转债	1,689,823.97	0.01
171	123188	水羊转债	1,649,581.44	0.01
172	113650	博22转债	1,641,004.06	0.01
173	123113	仙乐转债	1,628,286.99	0.01
174	113677	华懋转债	1,566,879.45	0.01
175	113664	大元转债	1,208,045.21	0.01
176	118038	金宏转债	1,152,932.88	0.01
177	128137	洁美转债	1,151,082.19	0.01

178	127093	章鼓转债	1,090,012.33	0.01
179	113579	健友转债	1,089,151.78	0.01
180	113660	寿22转债	1,079,975.89	0.01
181	123210	信服转债	1,047,978.63	0.01
182	127046	百润转债	855,244.08	0.00
183	110089	兴发转债	739,834.57	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	1,924,051,851.17	14,636,950,058.46	788,729,044.70	1,735,356,529.99
报告期期间基金总申购份额	82,001,987.18	485,683,743.50	18,738,861.48	390,995,035.75
减：报告期期间基金总赎回份额	386,035,457.20	2,067,179,747.38	93,333,768.33	643,329,315.54
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	1,620,018,381.15	13,055,454,054.58	714,134,137.85	1,483,022,250.20

§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	-	66,938,97	-	-

额		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	-	66,938,974.93	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	0.51	-	-

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

天弘基金管理有限公司
二〇二四年十月二十五日