

# 天弘安利短债债券型证券投资基金

## 2021年第2季度报告

2021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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2021年07月21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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年07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2021年04月01日起至2021年06月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	天弘安利短债	
基金主代码	010168	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年11月24日	
报告期末基金份额总额	807,286,609.74份	
投资目标	通过投资短期债券，在严格控制风险和保持较高流动性的前提下为投资人获取稳健回报。	
投资策略	本基金将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上，动态调整组合久期和债券的结构，并通过自下而上精选债券，获取优化收益。	
业绩比较基准	中债综合财富(1年以下)指数收益率	
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	天弘安利短债A	天弘安利短债C
下属分级基金的交易代码	010168	010169

报告期末下属分级基金的份额总额	218,827,277.23份	588,459,332.51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(2021年04月01日 - 2021年06月30日)	
	天弘安利短债A	天弘安利短债C
1. 本期已实现收益	146,885.82	4,007,720.00
2. 本期利润	196,409.14	5,400,139.13
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0138	0.0115
4. 期末基金资产净值	223,843,809.47	601,523,451.90
5. 期末基金份额净值	1.0229	1.0222

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

天弘安利短债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	1.16%	0.03%	0.78%	0.01%	0.38%	0.02%
过去六个月	1.92%	0.03%	1.53%	0.02%	0.39%	0.01%
自基金合同生效日起至今	2.29%	0.02%	2.05%	0.01%	0.24%	0.01%

天弘安利短债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	1.13%	0.03%	0.78%	0.01%	0.35%	0.02%
过去六个月	1.86%	0.03%	1.53%	0.02%	0.33%	0.01%
自基金合 同生效日 起至今	2.22%	0.02%	2.05%	0.01%	0.17%	0.01%

### 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

天弘安利短债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

(2020年11月24日-2021年06月30日)



天弘安利短债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2020年11月24日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2020年11月24日至2021年05月23日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

## § 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		
柴文婷	基金经理	2020年11月	-	10年	女，金融学硕士。历任嘉实基金管理有限公司行业研究员。2012年10月加盟本公司，历任研究员、交易员。
刘莹	基金经理	2020年11月	-	12年	女，管理科学与工程硕士。历任泰康资产管理有限公司交易员、信诚人寿保险

					有限公司研究员、南方基金管理有限公司基金经理、西南证券股份有限公司投资经理。2019年6月加盟本公司。
--	--	--	--	--	---

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

本基金本报告期内不存在异常交易行为。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，未产生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，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

经济层面，二季度我国经济总体延续稳定恢复态势，经济运行稳中加固、稳中向好。二季度PMI整体处于荣枯分界线上，呈现高位震荡态势，总体看生产端较为平稳，仍然保持在较高水平；需求端固定资产投资和出口向上，消费恢复相对较慢。通胀方面，

3-5月PPI上行速度最快的阶段已经过去，5月应是PPI同比的年内高点，5月过后基数逐渐恢复，PPI预计将从高位缓慢回落。CPI二季度同比由负转正，仍在2%以下低位运行。

海外层面，美欧等发达国家大面积接种疫苗，美国经济复苏强劲，制造业和服务业PMI基本处于历史最高水平。6月美联储议息会议维持基准利率水平与购债规模描述，并大幅上修今年经济增长及通胀预期，市场对美联储下半年退出宽松货币政策有一定预期。

政策层面，国内货币政策延续了一季度的表态，依然保持“稳字当头”的取向。央行明确了稳健的货币政策要灵活精准、合理适度，把握好政策时度效，保持流动性合理充裕，保持货币供应量和社会融资规模增速同名义经济增速基本匹配，保持宏观杠杆率基本稳定，并新增“维护经济大局总体平稳，增强经济发展韧性”这一表述。

资金层面，二季度银行间资金面保持了平稳运行。以公开市场逆回购利率、MLF利率为代表的政策利率保持不变，以DR007加权利率为代表的市场利率始终围绕着2.2%上下波动。

在二季度货币市场整体平稳运行、收益率下行的情况下，天弘安利短债采取稳健的投资策略，遵循资产负债相匹配的原则，坚持以高等级、短久期信用债为主要投资标的，合理使用杠杆，稳健配置资产。本基金在报告期内，为持有人创造了与风险相匹配的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2021年06月30日，天弘安利短债A基金份额净值为1.0229元，天弘安利短债C基金份额净值为1.0222元。报告期内份额净值增长率天弘安利短债A为1.16%，同期业绩比较基准增长率为0.78%；天弘安利短债C为1.13%，同期业绩比较基准增长率为0.78%。

#### 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	733,776,020.00	88.40
	其中：债券	733,776,020.00	88.40
	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	69,920,304.88	8.42
	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	4,746,743.69	0.57
8	其他资产	21,586,549.26	2.60
9	合计	830,029,617.83	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	43,051,200.00	5.22
	其中：政策性金融债	43,051,200.00	5.22
4	企业债券	9,435,720.00	1.14
5	企业短期融资券	300,597,500.00	36.42
6	中期票据	380,691,600.00	46.12
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	733,776,020.00	88.90

## 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	101752044	17华发集团MTN001	400,000	41,204,000.00	4.99
2	200309	20进出09	330,000	33,013,200.00	4.00
3	101800778	18成都高新MTN001	300,000	30,399,000.00	3.68
4	012100083	21苏交通SCP002	300,000	30,078,000.00	3.64
5	012101452	21海尔金控SCP004	300,000	30,063,000.00	3.64

#### 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	576.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,787,176.63
5	应收申购款	7,798,795.70
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	21,586,549.26

#### 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

	天弘安利短债A	天弘安利短债C
报告期期初基金份额总额	6,957,967.47	260,797,929.26
报告期期间基金总申购份额	214,018,398.14	557,128,961.23
减：报告期期间基金总赎回份额	2,149,088.38	229,467,557.98
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	218,827,277.23	588,459,332.51

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

### § 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

投资者类	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序	持有基金	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

别	号	份额比例 达到或者 超过20% 的时间区 间					
机 构	1	20210630	-	195,540,67 2.66	-	195,540,6 72.66	24.22%
<b>产品特有风险</b>							
<p>基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>(1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；</p> <p>(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；</p> <p>(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；</p> <p>(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；</p> <p>(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p>							

## 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安利短债债券型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘安利短债债券型证券投资基金基金合同
- 3、天弘安利短债债券型证券投资基金托管协议
- 4、天弘安利短债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  
二〇二一年七月二十一日