

天弘多元收益债券型证券投资基金

2021年第3季度报告

2021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:2021年10月27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2021年10月25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07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	天弘多元收益	
基金主代码	010118	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年10月29日	
报告期末基金份额总额	1,030,383,421.90份	
投资目标	本基金主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	主要投资策略包括：资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略、衍生产品投资策略。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×80%+沪深300指数收益率×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	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	天弘多元收益A	天弘多元收益C
下属分级基金的交易代码	010118	010119
报告期末下属分级基金的份额总	583,898,510.30份	446,484,911.60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(2021年07月01日 - 2021年09月30日)	
	天弘多元收益A	天弘多元收益C
1. 本期已实现收益	36,325,252.41	20,405,119.16
2. 本期利润	40,403,245.14	13,318,219.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1001	0.0617
4. 期末基金资产净值	685,470,042.26	522,712,519.37
5. 期末基金份额净值	1.1740	1.1707

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

天弘多元收益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	9.37%	0.60%	-0.68%	0.25%	10.05%	0.35%
过去六个月	15.43%	0.49%	0.41%	0.22%	15.02%	0.27%
自基金合同生效日起至今	17.40%	0.48%	2.43%	0.25%	14.97%	0.23%

天弘多元收益C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④
----	--------	----------	----------	----------	-----	-----

		②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	9.29%	0.60%	-0.68%	0.25%	9.97%	0.35%
过去六个月	15.24%	0.49%	0.41%	0.22%	14.83%	0.27%
自基金合同生效日起至至今	17.07%	0.48%	2.43%	0.25%	14.64%	0.23%

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

天弘多元收益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10月29日-2021年09月30日)



天弘多元收益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10月29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10月29日至2021年04月28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		
杜广	本基金基金经理	2020年10月	-	7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。

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

第三季度的7、8月份一直保持了相对高的转债仓位，9月上旬开始持续在做一些大的风险防范的动作，其背后的决策依据包括：①转债估值水平偏高、且进一步提升；②市场在中小盘转债上拥挤的状态；③十一之前，市场风险偏好阶段性下降的可能性。

但这种防范风险的动作仅限于对仓位做一些减持，很难是完全0-1之间自由切换的，从投资决策的角度，过于极端的操作也是十分危险的。目前市场并没有足够的理由确认有系统性风险，我们倾向于认为只是拥挤状态下调整风险的释放。四季度会对前期没有表现的低估值板块进行重点关注。

对于股票仓位，我们倾向于不做大的变化，依旧延续优质低估值龙头、行业均衡、个股分散的思路进行配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2021年09月30日，天弘多元收益A基金份额净值为1.1740元，天弘多元收益C基金份额净值为1.1707元。报告期内份额净值增长率天弘多元收益A为9.37%，同期业绩比较基准增长率为-0.68%；天弘多元收益C为9.29%，同期业绩比较基准增长率为-0.68%。

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	240,678,432.37	16.21
	其中：股票	240,678,432.37	16.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,109,416,013.47	74.71
	其中：债券	1,109,416,013.47	74.71
	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	124,540,739.84	8.39
8	其他资产	10,350,771.68	0.70
9	合计	1,484,985,957.36	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	13,321,814.00	1.10
C	制造业	147,583,141.37	12.22

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,479,160.00	0.78
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,185,272.00	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	19,003,104.00	1.57
K	房地产业	34,827,047.00	2.88
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,727,090.00	0.81
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	1,551,804.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	240,678,432.37	19.92

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	601233	桐昆股份	713,500	15,654,190.00	1.30
2	000002	万科A	682,200	14,537,682.00	1.20
3	601088	中国神华	587,900	13,321,814.00	1.10
4	000001	平安银行	719,300	12,897,049.00	1.07
5	600887	伊利股份	299,600	11,294,920.00	0.93
6	600048	保利发展	756,900	10,619,307.00	0.88
7	002001	新和成	391,700	10,521,062.00	0.87
8	600323	瀚蓝环境	367,060	9,727,090.00	0.81

9	600886	国投电力	786,000	9,479,160.00	0.78
10	002311	海大集团	138,775	9,353,435.00	0.77

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	101,218,546.10	8.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,037,000.00	0.50
	其中：政策性金融债	6,037,000.00	0.50
4	企业债券	407,008,300.00	33.69
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	131,339,000.00	10.87
7	可转债（可交换债）	463,813,167.37	38.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,109,416,013.47	91.83

注：可转债项下包含可交换债6,089,653.20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	102100353	21汇金MTN001	1,000,000	101,030,000.00	8.36
2	163353	20华泰G1	700,000	70,077,000.00	5.80
3	019658	21国债10	533,670	53,249,592.60	4.41
4	155743	19保利03	500,000	50,230,000.00	4.16
5	110072	广汇转债	309,570	30,910,564.50	2.56

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，【华泰证券股份有限公司】于2020年11月23日收到中国证券监督管理委员会江苏监管局出具警示函的通报。

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	145,648.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,236,049.23
5	应收申购款	1,969,073.73
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,350,771.68

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	110072	广汇转债	30,910,564.50	2.56
2	128144	利民转债	30,653,373.52	2.54
3	110051	中天转债	22,847,340.00	1.89
4	110045	海澜转债	18,716,262.40	1.55
5	110059	浦发转债	18,703,800.00	1.55
6	110077	洪城转债	17,037,830.90	1.41
7	110053	苏银转债	16,137,399.60	1.34

8	113601	塞力转债	12,749,505.10	1.06
9	128119	龙大转债	12,527,058.10	1.04
10	128109	楚江转债	11,921,999.40	0.99
11	123044	红相转债	9,545,448.00	0.79
12	127018	本钢转债	9,497,416.20	0.79
13	128066	亚泰转债	9,383,013.76	0.78
14	113545	金能转债	8,897,861.00	0.74
15	123077	汉得转债	8,886,446.40	0.74
16	123049	维尔转债	8,472,182.40	0.70
17	113620	傲农转债	7,689,457.30	0.64
18	113596	城地转债	7,428,871.80	0.61
19	128125	华阳转债	6,277,785.72	0.52
20	110061	川投转债	6,011,958.50	0.50
21	123060	苏试转债	5,953,246.09	0.49
22	110063	鹰19转债	5,853,201.40	0.48
23	128107	交科转债	5,704,541.70	0.47
24	113033	利群转债	5,594,240.70	0.46
25	110052	贵广转债	5,152,474.80	0.43
26	113042	上银转债	4,983,840.00	0.41
27	113561	正裕转债	4,843,701.60	0.40
28	123039	开润转债	4,463,212.70	0.37
29	128049	华源转债	4,269,361.00	0.35
30	132008	17山高EB	4,208,800.00	0.35
31	128138	侨银转债	3,932,734.00	0.33
32	113519	长久转债	3,646,042.40	0.30
33	110058	永鼎转债	3,512,217.60	0.29
34	123076	强力转债	3,123,495.88	0.26
35	123056	雪榕转债	2,929,747.38	0.24
36	128131	崇达转2	2,920,483.80	0.24
37	113606	荣泰转债	2,702,835.20	0.22
38	127015	希望转债	2,434,317.60	0.20
39	113599	嘉友转债	2,398,356.00	0.20
40	128114	正邦转债	2,343,732.40	0.19

41	123059	银信转债	2,335,137.50	0.19
42	113563	柳药转债	2,159,871.00	0.18
43	113535	大业转债	2,018,787.40	0.17
44	128069	华森转债	1,972,935.60	0.16
45	113604	多伦转债	1,965,412.80	0.16
46	123087	明电转债	1,959,250.30	0.16
47	113569	科达转债	1,272,193.50	0.11
48	128117	道恩转债	1,207,829.48	0.10
49	113597	佳力转债	1,167,453.00	0.10
50	110062	烽火转债	1,165,859.50	0.10
51	132009	17中油EB	1,156,633.20	0.10
52	113619	世运转债	1,050,078.40	0.09
53	110047	山鹰转债	1,021,161.60	0.08
54	113530	大丰转债	1,004,718.90	0.08
55	128063	未来转债	934,950.00	0.08
56	128118	瀛通转债	820,284.69	0.07
57	132004	15国盛EB	724,220.00	0.06
58	113566	翔港转债	706,532.40	0.06
59	127028	英特转债	635,738.70	0.05
60	127016	鲁泰转债	631,797.44	0.05
61	128056	今飞转债	620,966.19	0.05
62	113598	法兰转债	526,729.00	0.04
63	128034	江银转债	505,300.60	0.04
64	110064	建工转债	365,064.60	0.03
65	113542	好客转债	142,533.60	0.01
66	113011	光大转债	105,899.10	0.01
67	113577	春秋转债	78,565.50	0.01

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

	天弘多元收益A	天弘多元收益C
报告期期初基金份额总额	205,138,923.20	118,735,947.52
报告期期间基金总申购份额	419,446,297.52	399,188,084.06
减：报告期期间基金总赎回份额	40,686,710.42	71,439,119.98
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	583,898,510.30	446,484,911.60

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

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多元收益债券型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘多元收益债券型证券投资基金基金合同
- 3、天弘多元收益债券型证券投资基金托管协议
- 4、天弘多元收益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
二〇二一年十月二十七日