

# 天弘安利短债债券型证券投资基金

## 2021年第4季度报告

2021年12月31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:2022年01月24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2022年01月20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10月01日起至2021年12月31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	5,622,369,164.85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	主要投资策略包括：资产配置策略、债券类金融工具投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略。	
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	1,086,817,577.00份	4,535,551,587.85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10月01日 - 2021年12月31日)	
	天弘安利短债A	天弘安利短债C
1. 本期已实现收益	4,741,543.26	29,119,138.29
2. 本期利润	5,466,031.41	33,801,048.26
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0094	0.0092
4. 期末基金资产净值	1,133,576,559.83	4,724,606,690.07
5. 期末基金份额净值	1.0430	1.0417

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	0.95%	0.01%	0.61%	0.01%	0.34%	0.00%
过去六个月	1.97%	0.01%	1.29%	0.01%	0.68%	0.00%
过去一年	3.93%	0.02%	2.85%	0.01%	1.08%	0.01%
自基金合同生效日起至今	4.30%	0.02%	3.37%	0.01%	0.93%	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	0.92%	0.01%	0.61%	0.01%	0.31%	0.00%
过去六个月	1.91%	0.01%	1.29%	0.01%	0.62%	0.00%
过去一年	3.81%	0.02%	2.85%	0.01%	0.96%	0.01%
自基金合 同生效日 起至今	4.17%	0.02%	3.37%	0.01%	0.80%	0.01%

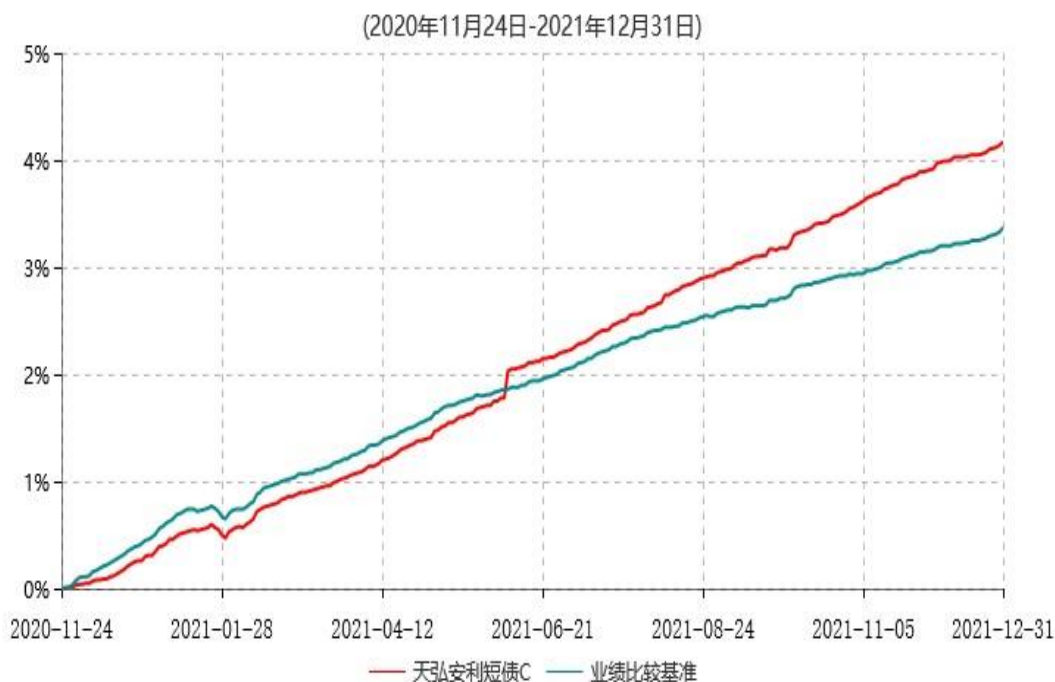
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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12月31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。

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	本基金基金经理	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	本基金基金经理	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10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

经济层面，四季度国内经济整体压力较大，依旧呈现出外需热、内需冷的态势。进出口方面，出口韧性仍强，进口小幅好转。投资方面，房地产投资低迷，基建投资也在低位。消费方面，在疫情影响下，消费和服务业仍然低迷，居民消费意愿较差。通胀方

面，在10月黑色大宗商品大跌后，PPI同比增速年内见顶；CPI则较为温和，同比增速在2%左右。

政策层面，在经济下行压力较大，通胀担忧有所缓解后，货币政策稳增长、保就业的重要性提高。11月19日央行发布2021年第三季度货币政策执行报告，其中对世界经济的看法从“前景改善”变为“复苏动能趋缓”；关于国内经济，央行明确指出“保持经济平稳运行的难度加大”。央行于12月15日下调金融机构存款准备金率0.5个百分点，此次降准共计释放长期资金约1.2万亿元。

资金层面，四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围绕着2.2%上下波动。

四季度，债券市场在经济基本面走弱、货币政策宽松的背景下，收益率走出了震荡下行的行情。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12月31日，天弘安利短债A基金份额净值为1.0430元，天弘安利短债C基金份额净值为1.0417元。报告期内份额净值增长率天弘安利短债A为0.95%，同期业绩比较基准增长率为0.61%；天弘安利短债C为0.92%，同期业绩比较基准增长率为0.61%。

#### 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	5,454,923,544.00	91.89
	其中：债券	5,454,923,544.00	91.89
	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	329,986,639.98	5.56
	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	21,517,111.97	0.36
8	其他资产	130,159,877.41	2.19
9	合计	5,936,587,173.36	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	300,080,000.00	5.12
	其中：政策性金融债	300,080,000.00	5.12
4	企业债券	114,956,274.00	1.96
5	企业短期融资券	2,708,846,600.00	46.24
6	中期票据	2,232,990,670.00	38.12
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	98,050,000.00	1.67
9	其他	-	-
10	合计	5,454,923,544.00	93.12

## 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	210206	21国开06	1,000,000	100,070,000.00	1.71
2	210201	21国开01	1,000,000	100,030,000.00	1.71



3	200302	20进出02	1,000,000	99,980,000.00	1.71
4	012105250	21中化股SCP024	1,000,000	99,950,000.00	1.71
5	112114157	21江苏银行CD157	1,000,000	98,050,000.00	1.67

#### 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，【中国进出口银行】于2021年07月13日收到中国银行保险监督管理委员会出具罚款处罚的通报。

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	5,127.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	90,042,786.87
5	应收申购款	40,111,963.23
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	130,159,877.41

**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	301,003,177.78	2,288,237,303.00
报告期期间基金总申购份额	814,469,837.62	4,117,897,544.16
减：报告期期间基金总赎回份额	28,655,438.40	1,870,583,259.31
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	1,086,817,577.00	4,535,551,587.85

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**

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》（财会(2017)7号）、《企业会计准则第23号—金融资产转移》（财会(2017)8号）、《企业会计准则第24号—套期

会计》（财会(2017)9号）、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（财会(2017)14号）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号）等相关规定，自 2022年1月1日起，天弘基金管理有限公司旗下资产管理产品开始执行新金融工具相关会计准则。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告》。

本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定，调整了本基金在基金销售机构及网上直销系统的单笔最低申购金额及单笔最低赎回份额，并于2021年11月26日生效。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在基金销售机构及网上直销系统的单笔最低申购金额及单笔最低赎回份额的公告》。

## §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  
二〇二二年一月二十四日