

天弘永利优佳混合型证券投资基金

2022年第4季度报告

2022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:北京银行股份有限公司

报告送出日期:2023年01月28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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年01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2022年10月01日起至2022年12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 天弘永利优佳混合 |
| 基金主代码 | 013569 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021年09月29日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,748,745,969.32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 | 主要投资策略包括：资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中债新综合指数（财富）收益率×90%+沪深300指数收益率×8%+中证港股通综合指数收益率×2% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |
| 基金管理人 | 天弘基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 北京银行股份有限公司 |

| | | |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 下属分级基金的基金简称 | 天弘永利优佳混合A | 天弘永利优佳混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013569 | 013570 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,606,240,533.20份 | 142,505,436.12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(2022年10月01日 - 2022年12月31日) | |
|----------------|--------------------------------|----------------|
| | 天弘永利优佳混合A | 天弘永利优佳混合C |
| 1.本期已实现收益 | -4,450,668.74 | -390,687.33 |
| 2.本期利润 | -22,568,448.89 | -1,356,933.10 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0083 | -0.0091 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,539,160,252.30 | 138,142,090.99 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9743 | 0.9694 |

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

天弘永利优佳混合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 | -0.85% | 0.20% | 0.47% | 0.13% | -1.32% | 0.07% |
| 过去六个月 | -1.74% | 0.17% | 0.10% | 0.11% | -1.84% | 0.06% |
| 过去一年 | -4.20% | 0.21% | 0.98% | 0.14% | -5.18% | 0.07% |
| 自基金合同生效日起至 今 | -2.57% | 0.19% | 2.11% | 0.13% | -4.68% | 0.06% |

天弘永利优佳混合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 | -0.96% | 0.20% | 0.47% | 0.13% | -1.43% | 0.07% |
| 过去六个月 | -1.94% | 0.17% | 0.10% | 0.11% | -2.04% | 0.06% |
| 过去一年 | -4.58% | 0.21% | 0.98% | 0.14% | -5.56% | 0.07% |
| 自基金合同生效日起至 今 | -3.06% | 0.19% | 2.11% | 0.13% | -5.17% | 0.06% |

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

天弘永利优佳混合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

(2021年09月29日-2022年12月31日)



天弘永利优佳混合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2021年09月29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2021年09月29日至2022年03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 | | |
| 任明 | 本基金基金经理 | 2021年10月 | - | 10年 | 男，金融学硕士。2012年7月加盟本公司，历任公司固定收益部债券研究员、信用研究员。 |
| 姜晓丽 | 固定收益业务总监、本基金基金经理，兼任固定收益 | 2021年09月 | - | 13年 | 女，经济学硕士。历任本公司债券研究员兼债券交易员、光大永明人寿保险有限公司债券研究员兼交易员。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。 |

| | | | | | |
|----|------------------|----------|---|-----|--|
| | 部、宏观研究部、混合资产部总经理 | | | | |
| 张寓 | 本基金基金经理 | 2021年09月 | - | 12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。 |

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2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

2022年4季度宏观经济现实层面依旧较弱，地产销售虽然出现底部企稳，但是离修复仍有很长的路要走，同时疫情的扩散进一步加大短期的经济压力，但是预期层面出现了明显的修复，自3季度末开始托底地产的政策不断加码，11月份中央出台了优化疫情防控的“二十条”，市场普遍预期经济最差时候即将过去；政策层面，宽松的货币政策仍然维系，资金利率依旧处于低于政策利率的水平，但是存单利率与MLF利率的利差逐步修复，市场对于未来短端利率的预期也逐步提升；金融市场方面，由于短端利率调整，导致短债及银行理财在11月和12月出现了两轮负债端的负反馈，导致债券市场出现了调整，尤其是前期利差压缩比较极致的信用债，最后2个月时间收益率普遍上行了100bp，但是在银保监会稳定市场的举措出现后，在年底理财负债端有所企稳，收益率从高位回落。报告期内，组合维持了比较低的杠杆和久期，在月底收益率调整后重新加仓了2年内AAA信用债，整体维持了稳健偏保守的操作。4季度政策层面的变化，对市场产生了根本性的影响：在全面恢复正常化后，除了消费、生产、生活等各方面将逐步恢复到正常的状态以外，相应的不确定性风险大幅度降低，这对整个市场的预期和估值体系，都有了根本性的改变。另外，地产政策的改变，对整个经济的走向也产生了根本性的影响：之前所担心的地产和相关金融体系的风险，在政策改变的框架下，得到托底和修复，这将对未来一段时间经济的企稳贡献重要的托底力量。在这两个极为重要变量发生根本性的变化的背景下，我们对市场的判断也由之前的中性和震荡，转为战略性看好权益市场。当然未来大概率还会存在一些反复的情形，包括疫情扩散后的次生问题，以及经济体恢复需要时间和恢复力度强弱的问题等等，但我们认为从中长期维度经济和市场逐步走出阴霾是大概率事件。

但这个过程也相对复杂。我们知道目前国内的经济结构和国际形势，都与以往有较大不同，这对我们的分析框架和理解范式都提出了新的要求。经济中重要的行业目前仍处于困境复苏的状态，但复苏的力度有多强以及稳定性延续性，这些都需要保持跟踪。如果说全面恢复后，经济就能回到之前强劲的状态，我们认为还是存疑。这包括：目前经济运行的库存偏高和需求偏弱，在没有强力拉动的情形下，经济整体要走出“去库存”的周期，还需要一定的时间；另一个是出口目前处于相对弱的状态，过去两年强力的出口对经济有较强的带动作用，而目前出口的走弱以及海外经济下行的不确定性，给出口拉动因素蒙上了一些阴影；地产在政策的支持下，企业主体端会救助，而市场端我们看到在2022年下半年，尤其是断贷事件发酵下，新屋销售环比保持了没有下滑，而二手房的销量也比较稳，加上居民端储蓄率的大幅上升，我们认为居民的购房能力和目前购房的意愿都是有底的，但好转起来能上升多少幅度，还需要再做跟踪和研判，但底部特征已经具备。在这些因素的交织下，我们认为未来一段时间，好的因素和不好的因素交织，可能使得经济复苏的步伐不像我们直接想象的那么直接和线性。

对于市场，我们认为可以更加乐观一些，因为之前我们列为重点风险的几个点，已经有以上两个大的风险得到了改变。资本市场是聪明和领先的，预期领先于现实，未来实体经济的逐步修复过程，将穿插着信心层面和现实层面的交叉互验上升，如果进一步

看到居民和企业家信心的改善，居民重新加大支出力度而非储蓄、企业家加大投资和创
新都是可以预期的，这将带来经济的重新上行，以及风险偏好的改善。

4季度，市场的估值水平中长期看具有一定的吸引力，并且随着国内放开防控，对于
风险偏好的提升有益，有利于估值的修复。基于此，我们增加了一定的顺周期板块的
配置，一些偏底部的优质企业可以开始做左侧的布局。另外在成长方向中，基于估值和
景气方向的考虑，增加了对风光储的配置。在我国有优势的制造业领域，未来的方向是
向高端制造业发展，我们仍然保持对相关领域的紧密跟踪，并根据产业趋势、技术进步
的方向去筛选，在组合中配置了相关的板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2022年12月31日，天弘永利优佳混合A基金份额净值为0.9743元，天弘永利优
佳混合C基金份额净值为0.9694元。报告期内份额净值增长率天弘永利优佳混合A为
-0.85%，同期业绩比较基准增长率为0.47%；天弘永利优佳混合C为-0.96%，同期业绩比
较基准增长率为0.47%。

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 | 414,055,470.90 | 11.41 |
| | 其中：股票 | 414,055,470.90 | 11.41 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,806,592,644.33 | 77.31 |
| | 其中：债券 | 2,806,592,644.33 | 77.31 |
| | 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 | 320,000,000.00 | 8.81 |
| | 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 | 65,094,589.54 | 1.79 |

| | | | |
|---|------|------------------|--------|
| 8 | 其他资产 | 24,621,905.61 | 0.68 |
| 9 | 合计 | 3,630,364,610.38 | 100.00 |

注：本报告期末，本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为298,352.18元，占基金资产净值的比例为0.01%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 6,799,884.00 | 0.25 |
| C | 制造业 | 327,423,058.23 | 12.23 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,978,186.00 | 0.41 |
| E | 建筑业 | 8,929,360.00 | 0.33 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,849,584.00 | 0.29 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 14,978,812.74 | 0.56 |
| J | 金融业 | 26,855,750.38 | 1.00 |
| K | 房地产业 | 9,590,907.00 | 0.36 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 12,998.08 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 226,310.59 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 106,663.20 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,604.50 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 413,757,118.72 | 15.45 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----------|------------|---------------|
| 基础材料 | - | - |
| 非日常生活消费品 | - | - |
| 日常消费品 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 电信服务 | 298,352.18 | 0.01 |
| 公用事业 | - | - |
| 地产业 | - | - |
| 合计 | 298,352.18 | 0.01 |

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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 | 002142 | 宁波银行 | 825,060 | 26,773,197.00 | 1.00 |
| 2 | 600989 | 宝丰能源 | 2,180,400 | 26,317,428.00 | 0.98 |
| 3 | 002601 | 龙佰集团 | 1,320,100 | 24,976,292.00 | 0.93 |
| 4 | 600426 | 华鲁恒升 | 662,700 | 21,968,505.00 | 0.82 |
| 5 | 300274 | 阳光电源 | 192,900 | 21,566,220.00 | 0.81 |
| 6 | 603601 | 再升科技 | 2,994,880 | 15,812,966.40 | 0.59 |
| 7 | 300596 | 利安隆 | 270,100 | 14,739,357.00 | 0.55 |
| 8 | 002415 | 海康威视 | 410,700 | 14,243,076.00 | 0.53 |
| 9 | 002487 | 大金重工 | 337,100 | 13,945,827.00 | 0.52 |
| 10 | 002643 | 万润股份 | 932,834 | 13,675,346.44 | 0.51 |

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 | 50,031,767.96 | 1.87 |

| | | | |
|----|-----------|------------------|--------|
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 427,035,301.92 | 15.95 |
| | 其中：政策性金融债 | 253,520,657.54 | 9.47 |
| 4 | 企业债券 | 1,679,887,032.80 | 62.75 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 483,211,853.15 | 18.05 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 166,426,688.50 | 6.22 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,806,592,644.33 | 104.83 |

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 | 175741 | 21海通02 | 1,800,000 | 186,833,411.51 | 6.98 |
| 2 | 188808 | 21沪盛02 | 1,500,000 | 151,057,602.74 | 5.64 |
| 3 | 175705 | 21招证C1 | 1,000,000 | 103,664,904.11 | 3.87 |
| 4 | 210316 | 21进出16 | 1,000,000 | 101,669,178.08 | 3.80 |
| 5 | 188864 | 21信投11 | 1,000,000 | 101,033,835.62 | 3.77 |

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在参与国债期货交易时，将主要采取套期保值的方式参与国债期货的投资交易，以管理市场风险和调节债券仓位为主要目的。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| | |
|-------------------|-------------|
| 公允价值变动总额合计（元） | - |
| 国债期货投资本期收益（元） | 48,327.66 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | -182,000.00 |

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约进行交易。本基金力争通过国债期货的交易，降低组合债券持仓调整的交易成本，增加组合的灵活性，对冲潜在风险。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

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，【招商证券股份有限公司】于2022年09月19日收到中国证券监督管理委员会出具责令改正、公开处罚的通报；【中国进出口银行】于2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【中国农业发展银行】于2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【中信银行股份有限公司】于2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会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 | 501,387.09 |
| 2 | 应收证券清算款 | 23,655,344.24 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 465,174.28 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 24,621,905.61 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|------|------|---------|--------------|
|---|------|------|---------|--------------|

| 号 | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 1 | 127049 | 希望转2 | 11,601,302.54 | 0.43 |
| 2 | 113648 | 巨星转债 | 9,850,754.45 | 0.37 |
| 3 | 127018 | 本钢转债 | 9,420,092.42 | 0.35 |
| 4 | 128081 | 海亮转债 | 9,137,494.60 | 0.34 |
| 5 | 113049 | 长汽转债 | 8,822,348.84 | 0.33 |
| 6 | 128023 | 亚太转债 | 8,256,725.46 | 0.31 |
| 7 | 128140 | 润建转债 | 7,436,132.24 | 0.28 |
| 8 | 127050 | 麒麟转债 | 7,180,556.27 | 0.27 |
| 9 | 123089 | 九洲转2 | 6,744,309.76 | 0.25 |
| 10 | 123107 | 温氏转债 | 6,301,895.06 | 0.24 |
| 11 | 127022 | 恒逸转债 | 6,253,350.06 | 0.23 |
| 12 | 127030 | 盛虹转债 | 6,217,229.22 | 0.23 |
| 13 | 123085 | 万顺转2 | 5,899,864.81 | 0.22 |
| 14 | 113524 | 奇精转债 | 5,680,175.18 | 0.21 |
| 15 | 113045 | 环旭转债 | 5,653,989.27 | 0.21 |
| 16 | 123088 | 威唐转债 | 5,621,506.19 | 0.21 |
| 17 | 113577 | 春秋转债 | 5,609,369.84 | 0.21 |
| 18 | 127037 | 银轮转债 | 5,576,114.51 | 0.21 |
| 19 | 127061 | 美锦转债 | 3,972,440.62 | 0.15 |
| 20 | 127054 | 双箭转债 | 3,936,724.85 | 0.15 |
| 21 | 127038 | 国微转债 | 3,540,728.76 | 0.13 |
| 22 | 113600 | 新星转债 | 2,620,425.25 | 0.10 |
| 23 | 127046 | 百润转债 | 1,339,621.29 | 0.05 |
| 24 | 127035 | 濮耐转债 | 1,132,157.53 | 0.04 |
| 25 | 127005 | 长证转债 | 1,115,546.82 | 0.04 |
| 26 | 110073 | 国投转债 | 525,208.63 | 0.02 |

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

| | 天弘永利优佳混合A | 天弘永利优佳混合C |
|-------------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,861,349,674.98 | 157,546,967.39 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,539,488.82 | 1,308,851.03 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 256,648,630.60 | 16,350,382.30 |
| 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 | 2,606,240,533.20 | 142,505,436.12 |

§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永利优佳混合型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘永利优佳混合型证券投资基金基金合同
- 3、天弘永利优佳混合型证券投资基金托管协议
- 4、天弘永利优佳混合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
二〇二三年一月二十八日