

天弘永利优佳混合型证券投资基金

2022年第2季度报告

2022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:北京银行股份有限公司

报告送出日期:2022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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022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2022年04月01日起至2022年06月30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	3,325,515,677.61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	3,140,037,190.68份	185,478,486.93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04月01日 - 2022年06月30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	-18,396,676.15	-1,302,326.39
2. 本期利润	34,187,070.05	1,860,847.35
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0107	0.0096
4. 期末基金资产净值	3,113,588,692.58	183,364,796.56
5. 期末基金份额净值	0.9916	0.9886

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	1.13%	0.19%	1.60%	0.13%	-0.47%	0.06%
过去六个月	-2.50%	0.24%	0.88%	0.16%	-3.38%	0.08%
自基金合同生效日起至今	-0.84%	0.21%	2.01%	0.13%	-2.85%	0.08%

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	1.02%	0.19%	1.60%	0.13%	-0.58%	0.06%
过去六个月	-2.69%	0.24%	0.88%	0.16%	-3.57%	0.08%
自基金合同生效日起至今	-1.14%	0.21%	2.01%	0.13%	-3.15%	0.08%

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06月30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，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，兼任固定收益部、宏观研究部、混合资产部总经理	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。
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

本基金本报告期内不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年二季度，除了疫情影响了部分城市外，经济出现进一步的下行压力，地产销售恢复偏慢，同时出口也转弱，货币政策整体维持宽松的状态，信用债收益率出现了明显的下行，利率债先下后上，处于窄幅震荡的格局。运作期内，在货币市场稳定的前提，适度组合的杠杆水平，整体获得了2季度的信用债的票息收益和杠杆收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2022年06月30日，天弘永利优佳混合A基金份额净值为0.9916元，天弘永利优佳混合C基金份额净值为0.9886元。报告期内份额净值增长率天弘永利优佳混合A为1.13%，同期业绩比较基准增长率为1.60%；天弘永利优佳混合C为1.02%，同期业绩比较基准增长率为1.60%。

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	351,985,070.01	9.90
	其中：股票	351,985,070.01	9.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,062,546,821.45	86.15
	其中：债券	3,062,546,821.45	86.15
	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	59,221,213.46	1.67
8	其他资产	81,008,899.40	2.28
9	合计	3,554,762,004.32	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25,532,552.64元，占基金资产净值的比例为0.77%。

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	3,901,785.44	0.12
C	制造业	154,481,325.45	4.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,647,317.24	1.08
E	建筑业	27,795,494.00	0.84
F	批发和零售业	36,292.74	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	6,019,984.00	0.18
H	住宿和餐饮业	13,636,720.00	0.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,534,923.57	0.20
J	金融业	35,844,330.00	1.09
K	房地产业	27,720,108.00	0.84
L	租赁和商务服务业	8,058,271.78	0.24
M	科学研究和技术服务业	6,262,584.13	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	303,760.33	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	209,620.69	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	326,452,517.37	9.90

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	5,832,395.80	0.18
电信服务	19,700,156.84	0.60
公用事业	-	-
地产业	-	-
合计	25,532,552.64	0.77

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	600039	四川路桥	2,103,000	22,144,590.00	0.67
2	600048	保利发展	1,227,000	21,423,420.00	0.65
3	00700	腾讯控股	65,000	19,700,156.84	0.60
4	603601	再升科技	2,994,880	19,047,436.80	0.58
5	601166	兴业银行	769,200	15,307,080.00	0.46
6	600754	锦江酒店	216,800	13,636,720.00	0.41
7	601012	隆基绿能	198,920	13,254,039.60	0.40
8	600011	华能国际	1,514,400	10,661,376.00	0.32
9	002415	海康威视	289,600	10,483,520.00	0.32
10	002371	北方华创	34,700	9,616,064.00	0.29

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	140,115,862.41	4.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	412,182,617.53	12.50
	其中：政策性金融债	235,304,380.81	7.14
4	企业债券	2,030,629,617.44	61.59

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	463,887,032.33	14.07
7	可转债（可交换债）	15,731,691.74	0.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,062,546,821.45	92.89

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	185,576,183.01	5.63
2	188808	21沪盛02	1,500,000	153,592,561.65	4.66
3	019658	21国债10	1,350,000	137,571,657.54	4.17
4	210316	21进出16	1,000,000	104,734,383.56	3.18
5	175705	21招证C1	1,000,000	103,151,917.81	3.13

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，【海通证券股份有限公司】于2021年10月14日收到中国证券监督管理委员会重庆监管局出具责令改正、公开处罚的通报；【中国进出口银行】分别于2021年07月13日、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，于2022年06月09日收到中国银行保险监督管理委员会丽水监管分局出具公开处罚的通报。

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	1,002,064.92
2	应收证券清算款	79,986,183.10
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,651.38
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	81,008,899.40

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	123107	温氏转债	6,639,093.82	0.20
2	127049	希望转2	3,682,504.26	0.11
3	127050	麒麟转债	1,264,925.48	0.04
4	110079	杭银转债	1,252,824.11	0.04
5	127005	长证转债	1,186,313.66	0.04
6	127035	濮耐转债	1,171,031.23	0.04
7	110073	国投转债	534,999.18	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	3,305,818,991.73	202,740,714.33
报告期期间基金总申购份额	9,572,434.02	2,828,230.70
减：报告期期间基金总赎回份额	175,354,235.07	20,090,458.10
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	3,140,037,190.68	185,478,486.93

§ 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
二〇二二年七月二十一日