
天弘安盈一年持有期债券型发起式证券投资基金

2023年第3季度报告

2023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:中国银河证券股份有限公司

报告送出日期:2023年10月25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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月23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2023年07月01日起至2023年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘安盈一年持有
基金主代码	012049
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年05月12日
报告期末基金份额总额	2,880,327,277.82份
投资目标	在严格控制风险的前提下，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、债券投资策略、股票投资策略、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×85%+沪深300指数收益率×12%+中证港股通综合指数收益率×3%
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。本基金将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	中国银河证券股份有限公司

下属分级基金的基金简称	天弘安盈一年持有A	天弘安盈一年持有C
下属分级基金的交易代码	012049	012050
报告期末下属分级基金的份额总额	217,159,275.24份	2,663,168,002.58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(2023年07月01日 - 2023年09月30日)	
	天弘安盈一年持有A	天弘安盈一年持有C
1.本期已实现收益	-2,147,994.70	-25,892,027.02
2.本期利润	2,217,189.36	17,769,074.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0085	0.0061
4.期末基金资产净值	225,070,334.10	2,737,282,311.30
5.期末基金份额净值	1.0364	1.0278

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

天弘安盈一年持有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	0.61%	0.13%	-0.04%	0.13%	0.65%	0.00%
过去六个月	-0.60%	0.17%	0.73%	0.13%	-1.33%	0.04%
过去一年	-0.05%	0.20%	2.85%	0.15%	-2.90%	0.05%
自基金合同生效日起至今	3.64%	0.21%	4.27%	0.17%	-0.63%	0.04%

天弘安盈一年持有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	0.52%	0.13%	-0.04%	0.13%	0.56%	0.00%
过去六个月	-0.77%	0.17%	0.73%	0.13%	-1.50%	0.04%
过去一年	-0.40%	0.20%	2.85%	0.15%	-3.25%	0.05%
自基金合同生效日起至 今	2.78%	0.21%	4.27%	0.17%	-1.49%	0.04%

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

天弘安盈一年持有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05月12日-2023年09月30日)

天弘安盈一年持有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
(2021年05月12日-2023年09月30日)



注：1、本基金合同于2021年05月12日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§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	固定收益部总经理助理兼信用研究部负责人，本基金基金经理	2021年11月	-	11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、混合资产部部门总经理	2021年05月	-	14年	女，经济学硕士。历任本公司债券研究员、债券交易员、光大永明人寿保险有限公司债券研究员、债券交易员。2011年8月加盟本公司，历任固定收益研究员等。
贺剑	本基金基金经理	2021年05月	2023年09月	16年	男，金融学硕士。历任华夏基金管理有限公司风险分析师、研究员、投资经理，2020年5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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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1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

经济经历过2季度的超预期压力后，3季度我们观察到经济触底的迹象越来越多，从海外经济到国内经济；同时，随着经济压力的加大，国内宏观政策非常积极；同时，我们看到中美关系的改善。这些都加强了我们对股票市场的判断，我们认为未来两个季度将是股票市场相对宝贵的配置窗口，之后的不确定性还比较多。这中间也有一些质疑点，汇率可能是个重要方面，但我们认为，从2022年开始的人民币贬值已经走到了末段位置，当下的发酵和关注更多是滞后的反应，不能作为领先指标。

从具体配置上，我们重视长期的稳健性，我们选取了有核心竞争力的个股，同时要求环境有利、估值合理，更偏重运营类资产，也增加了一些估值偏低的消费类资产，以稳健地争取绝对收益。

2023年3季度，经济最差的时候逐步过去，货币政策逐步宽松，但是由于中美经济周期的错位，人民币出现一定程度的贬值压力，同时叠加季末地方债集中发行，对银行基础货币出现了一定的消耗，导致降息后资金利率中枢不降反升，带动债券收益率先下后上出现调整。运作期内，组合纯债部分适度降低了组合的久期，以票息策略为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2023年09月30日，天弘安盈一年持有A基金份额净值为1.0364元，天弘安盈一年持有C基金份额净值为1.0278元。报告期内份额净值增长率天弘安盈一年持有A为0.61%，同期业绩比较基准增长率为-0.04%；天弘安盈一年持有C为0.52%，同期业绩比较基准增长率为-0.04%。

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	283,831,724.39	7.29
	其中：股票	283,831,724.39	7.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,571,239,224.96	91.75
	其中：债券	3,571,239,224.96	91.75
	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	29,471,119.66	0.76
8	其他资产	7,999,381.39	0.21

9	合计	3,892,541,450.40	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38,863,898.99元，占基金资产净值的比例为1.31%。

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	15,443,868.00	0.52
B	采矿业	15,800,392.00	0.53
C	制造业	118,917,954.40	4.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,960,624.00	0.64
F	批发和零售业	30,508,734.00	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	15,410,717.00	0.52
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	17,924,934.00	0.61
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,436,007.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	8,564,595.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	244,967,825.40	8.27

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	2,867,822.61	0.10
非日常生活消费品	841.28	0.00
日常消费品	-	-
能源	14,112,184.53	0.48
金融	-	-
医疗保健	13,614,619.37	0.46
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	8,268,431.20	0.28
公用事业	-	-
地产业	-	-
合计	38,863,898.99	1.31

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	600887	伊利股份	997,200	26,455,716.00	0.89
2	600511	国药股份	517,900	17,168,385.00	0.58
3	300498	温氏股份	888,600	15,443,868.00	0.52
4	300408	三环集团	463,400	14,365,400.00	0.48
5	00883	中国海洋石油	1,116,034	14,112,184.53	0.48
6	601390	中国中铁	2,052,800	14,000,096.00	0.47
7	01099	国药控股	653,600	13,614,619.37	0.46
8	601088	中国神华	384,800	12,005,760.00	0.41
9	002475	立讯精密	328,400	9,792,888.00	0.33
10	002601	龙佰集团	509,700	9,363,189.00	0.32

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	732,877,852.32	24.74

	其中：政策性金融债	339,131,314.61	11.45
4	企业债券	1,798,080,257.56	60.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	743,515,428.78	25.10
7	可转债（可交换债）	296,712,814.04	10.02
8	同业存单	-	-
9	其他	52,872.26	0.00
10	合计	3,571,239,224.96	120.55

注：其他项下包含地方政府债52,872.26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	149989	22广发01	1,500,000	150,820,849.32	5.09
2	137693	22光证G3	1,500,000	149,751,657.54	5.06
3	210202	21国开02	1,000,000	102,401,726.03	3.46
4	210316	21进出16	1,000,000	102,280,163.93	3.45
5	185221	22中化01	1,000,000	101,683,227.40	3.43

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，【广发证券股份有限公司】于2023年08月22日收到中国人民银行广东省分行出具罚款处罚的通报，于2023年09月22日收到中国证券监督管理委员会出具公开批评、公开处罚、责令改正的通报；【国泰君安证券股份有限公司】于2023年01月12日收到中国人民银行上海分行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	1,170,099.08
2	应收证券清算款	6,317,181.30
3	应收股利	473,192.79
4	应收利息	-
5	应收申购款	38,908.22
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,999,381.39

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	113042	上银转债	26,176,471.23	0.88
2	110059	浦发转债	23,120,077.31	0.78
3	123107	温氏转债	18,080,268.93	0.61
4	127049	希望转2	16,065,199.91	0.54
5	110086	精工转债	14,860,315.44	0.50
6	127061	美锦转债	13,636,555.44	0.46
7	123128	首华转债	13,384,785.99	0.45
8	123113	仙乐转债	13,073,644.10	0.44
9	127033	中装转2	12,601,093.92	0.43
10	113624	正川转债	12,218,118.72	0.41
11	113535	大业转债	11,023,705.48	0.37
12	113623	凤21转债	9,971,741.88	0.34
13	123056	雪榕转债	8,269,580.84	0.28

14	113542	好客转债	7,451,730.12	0.25
15	110075	南航转债	7,129,724.70	0.24
16	110073	国投转债	7,109,635.08	0.24
17	123104	卫宁转债	6,164,553.27	0.21
18	128141	旺能转债	5,705,164.77	0.19
19	113641	华友转债	5,231,343.94	0.18
20	113602	景20转债	5,226,027.82	0.18
21	113610	灵康转债	4,964,963.91	0.17
22	128026	众兴转债	4,858,280.90	0.16
23	123004	铁汉转债	4,689,803.80	0.16
24	113656	嘉诚转债	4,522,973.35	0.15
25	113606	荣泰转债	3,849,430.97	0.13
26	113033	利群转债	3,789,894.06	0.13
27	128063	未来转债	3,690,554.79	0.12
28	113631	皖天转债	3,609,282.92	0.12
29	110087	天业转债	3,407,822.35	0.12
30	127018	本钢转债	2,586,380.19	0.09
31	127046	百润转债	2,442,917.71	0.08
32	123133	佩蒂转债	2,433,776.28	0.08
33	123153	英力转债	2,409,694.07	0.08
34	127073	天赐转债	2,327,108.42	0.08
35	110089	兴发转债	1,702,711.91	0.06
36	113605	大参转债	1,673,889.43	0.06
37	123132	回盛转债	1,535,754.23	0.05
38	128129	青农转债	776,606.00	0.03
39	113638	台21转债	375,764.89	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

	天弘安盈一年持有A	天弘安盈一年持有C
报告期期初基金份额总额	319,142,327.62	3,167,884,020.20
报告期期间基金总申购份额	630,381.58	6,109,075.28
减：报告期期间基金总赎回份额	102,613,433.96	510,825,092.90
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	217,159,275.24	2,663,168,002.58

§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

单位：份

	天弘安盈一年持有A	天弘安盈一年持有C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,002,639.42	5,002,638.89
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,002,639.42	5,002,638.89
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.30	0.19

注：报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自级别的份额总额计算。

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,005,278.31	0.35%	10,005,278.31	0.35%	三年
基金管理人高	-	-	-	-	-

级管理人员					
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,005,278.31	0.35%	10,005,278.31	0.35%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，韩歆毅先生代任公司总经理，郭树强先生不再担任公司总经理，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高级管理人员变更的公告》。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘安盈一年持有期债券型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘安盈一年持有期债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、天弘安盈一年持有期债券型发起式证券投资基金托管协议
- 4、天弘安盈一年持有期债券型发起式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

10.2 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

10.3 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
二〇二三年十月二十五日