
天弘添利债券型证券投资基金（LOF）

2024年第3季度报告

2024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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024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2024年07月01日起至2024年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘添利 LOF	
场内简称	天弘添利LOF	
基金主代码	164206	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年12月03日	
报告期末基金份额总额	1,044,356,324.89份	
投资目标	本基金在追求基金资产稳定增值的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	资产配置策略、债券投资策略、新股申购策略。	
业绩比较基准	中国债券总指数。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险收益预期高于货币市场基金，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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	天弘添利LOF C	天弘添利LOF E
下属分级基金场内简称	天弘添利LOF	-
下属分级基金的交易代码	164206	009512
报告期末下属分级基金的份额总额	811,205,557.05份	233,150,767.84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(2024年07月01日 - 2024年09月30日)	
	天弘添利LOF C	天弘添利LOF E
1.本期已实现收益	-34,910,497.28	-8,242,285.30
2.本期利润	32,237,669.76	9,608,538.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0400	0.0418
4.期末基金资产净值	1,102,282,172.65	274,622,748.29
5.期末基金份额净值	1.3588	1.1779

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

天弘添利LOF 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	3.29%	1.36%	0.44%	0.13%	2.85%	1.23%
过去六个月	5.97%	1.16%	1.43%	0.11%	4.54%	1.05%
过去一年	-2.88%	1.03%	3.54%	0.10%	-6.42%	0.93%
过去三年	-4.86%	1.01%	5.41%	0.09%	-10.27%	0.92%
过去五年	30.62%	0.86%	7.73%	0.10%	22.89%	0.76%
自基金转型日起至今	51.91%	0.65%	9.34%	0.10%	42.57%	0.55%

天弘添利LOF E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	3.39%	1.36%	0.44%	0.13%	2.95%	1.23%
过去六个月	6.16%	1.15%	1.43%	0.11%	4.73%	1.04%
过去一年	-2.53%	1.03%	3.54%	0.10%	-6.07%	0.93%
过去三年	-3.84%	1.01%	5.41%	0.09%	-9.25%	0.92%
自基金份额 首次确认日 起至今	22.87%	0.90%	4.07%	0.09%	18.80%	0.81%

3.2.2 自基金转型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

天弘添利LOF 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
(2015年12月04日-2024年09月30日)



天弘添利LOF E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05月25日-2024年09月30日)



注：1、本基金合同于2010年12月03日生效。根据基金合同约定，本基金于2015年12月03日五年封闭期届满，封闭期届满后本基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“天弘添利债券型证券投资基金（LOF）”。

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。

3、本基金自2020年05月22日起增设天弘添利LOF E基金份额。天弘添利LOF E基金份额的首次确认日为2020年05月25日。

§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	2019年11月	-	10年	男，应用经济学博士。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，历任投资经理助理等。

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

9月底的政策礼包，是对逆向价值投资者的奖赏。我们前期基于极其诱人的价格相对价值的折扣，一直保持了较高的仓位，也终于迎来了收获。

市场上大部分投资者都希望自己既买到折扣，又能够顺“势”。这个“势”，可以是基本面的趋势，或者股价的趋势。但这都只是如海市蜃楼般的理想。顺“势”带给投资者的心理的舒适度，必然以低折扣甚至溢价为代价，同时也承担了这个“势”的终结带来的股价的坍塌。

反之，逆向投资者表面上与趋势为敌，似乎承担了巨大的风险，但实际上却是风险更小的选择。首先是由于股票下跌后带来的风险释放，更重要的是投资者去对抗市场时，所必经的严肃、独立的思考，对底线价值的充分评估。

逆向给了我们正向的激励和反馈，这也是过去一个季度最大的收获。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2024年09月30日，天弘添利LOF C基金份额净值为1.3588元，天弘添利LOF E基金份额净值为1.1779元。报告期内份额净值增长率天弘添利LOF C为3.29%，同期业绩比较基准增长率为0.44%；天弘添利LOF E为3.39%，同期业绩比较基准增长率为0.44%。

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	1,531,721,643.81	98.13
	其中：债券	1,531,721,643.81	98.13
	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	17,414,475.03	1.12
8	其他资产	11,846,099.82	0.76
9	合计	1,560,982,218.66	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	76,529,111.88	5.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,385,868.49	1.48
7	可转债（可交换债）	1,434,806,663.44	104.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,531,721,643.81	111.24

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	127084	柳工转2	764,432	125,026,539.63	9.08
2	127049	希望转2	620,445	62,791,447.79	4.56
3	123225	翔丰转债	302,891	36,990,285.38	2.69
4	123237	佳禾转债	267,441	31,691,318.87	2.30
5	127103	东南转债	303,186	29,253,868.91	2.12

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 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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	61,973.12
2	应收证券清算款	3,693,535.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,090,591.04
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	11,846,099.82

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	127084	柳工转2	125,026,539.63	9.08
2	127049	希望转2	62,791,447.79	4.56
3	123225	翔丰转债	36,990,285.38	2.69
4	123237	佳禾转债	31,691,318.87	2.30
5	127103	东南转债	29,253,868.91	2.12
6	118026	利元转债	24,667,495.57	1.79
7	127099	盛航转债	22,652,682.96	1.65
8	113058	友发转债	20,810,122.00	1.51
9	123128	首华转债	20,229,450.73	1.47
10	127101	豪鹏转债	19,356,820.85	1.41
11	123191	智尚转债	19,160,387.44	1.39

12	118043	福立转债	18,675,961.51	1.36
13	127061	美锦转债	18,322,177.48	1.33
14	123227	雅创转债	18,084,083.58	1.31
15	123226	中富转债	18,020,167.72	1.31
16	123076	强力转债	17,703,558.89	1.29
17	128144	利民转债	16,923,509.77	1.23
18	110081	闻泰转债	16,679,082.33	1.21
19	118028	会通转债	16,254,310.88	1.18
20	113667	春23转债	15,888,013.96	1.15
21	123187	超达转债	15,868,577.85	1.15
22	118020	芳源转债	15,857,367.80	1.15
23	123240	楚天转债	15,820,543.07	1.15
24	110086	精工转债	15,301,379.39	1.11
25	127077	华宏转债	14,965,993.15	1.09
26	118041	星球转债	14,792,270.22	1.07
27	123202	祥源转债	14,476,774.12	1.05
28	123207	冠中转债	14,137,821.36	1.03
29	123206	开能转债	13,823,701.73	1.00
30	123218	宏昌转债	13,760,189.70	1.00
31	127053	豪美转债	13,698,452.42	0.99
32	123177	测绘转债	13,647,569.53	0.99
33	127081	中旗转债	13,581,512.49	0.99
34	110095	双良转债	13,308,531.34	0.97
35	123163	金沃转债	13,152,583.53	0.96
36	123190	道氏转02	13,089,972.25	0.95
37	128118	瀛通转债	12,964,320.96	0.94
38	123175	百畅转债	12,657,230.05	0.92
39	123141	宏丰转债	12,654,806.94	0.92
40	123198	金埔转债	12,571,255.12	0.91
41	118035	国力转债	12,305,701.70	0.89
42	111018	华康转债	12,218,052.51	0.89
43	123213	天源转债	12,060,805.89	0.88
44	123200	海泰转债	12,026,056.32	0.87

45	123216	科顺转债	11,965,121.95	0.87
46	123168	惠云转债	11,962,847.69	0.87
47	123224	宇邦转债	11,909,322.67	0.86
48	128090	汽模转2	11,838,391.83	0.86
49	123211	阳谷转债	11,822,058.80	0.86
50	123162	东杰转债	11,094,090.27	0.81
51	128130	景兴转债	11,033,418.71	0.80
52	111012	福新转债	10,550,988.05	0.77
53	123199	山河转债	10,524,873.79	0.76
54	123107	温氏转债	10,321,961.40	0.75
55	123220	易瑞转债	10,245,737.24	0.74
56	127087	星帅转2	10,099,522.92	0.73
57	127060	湘佳转债	9,953,851.29	0.72
58	123204	金丹转债	9,907,939.44	0.72
59	123214	东宝转债	9,503,075.88	0.69
60	123063	大禹转债	9,467,339.19	0.69
61	113662	豪能转债	9,013,131.73	0.65
62	113629	泉峰转债	9,003,607.23	0.65
63	113573	纵横转债	8,949,426.06	0.65
64	123089	九洲转2	8,886,728.24	0.65
65	113628	晨丰转债	8,824,043.84	0.64
66	123234	中能转债	8,524,252.70	0.62
67	123219	宇瞳转债	7,915,915.40	0.57
68	127105	龙星转债	7,784,679.94	0.57
69	123130	设研转债	7,364,600.72	0.53
70	127055	精装转债	7,354,695.68	0.53
71	123087	明电转债	7,127,082.23	0.52
72	127094	红墙转债	7,115,000.67	0.52
73	111016	神通转债	6,497,204.83	0.47
74	123212	立中转债	6,358,468.57	0.46
75	111015	东亚转债	6,193,080.62	0.45
76	123147	中辰转债	6,122,038.33	0.44
77	123171	共同转债	5,920,861.98	0.43

78	113676	荣23转债	5,467,640.80	0.40
79	123203	明电转02	5,313,245.64	0.39
80	111010	立昂转债	4,824,419.86	0.35
81	113674	华设转债	4,757,254.48	0.35
82	127070	大中转债	4,386,254.40	0.32
83	123205	大叶转债	4,353,396.87	0.32
84	113668	鹿山转债	4,235,384.03	0.31
85	127068	顺博转债	4,033,024.39	0.29
86	110047	山鹰转债	4,011,921.27	0.29
87	123201	纽泰转债	3,948,682.70	0.29
88	113549	白电转债	3,740,314.88	0.27
89	123135	泰林转债	3,394,802.27	0.25
90	113050	南银转债	3,268,305.42	0.24
91	118012	微芯转债	3,248,291.82	0.24
92	123209	聚隆转债	3,192,435.35	0.23
93	118023	广大转债	2,767,032.41	0.20
94	123217	富仕转债	2,727,330.47	0.20
95	118016	京源转债	2,645,201.54	0.19
96	127028	英特转债	2,626,092.03	0.19
97	123172	漱玉转债	2,377,928.96	0.17
98	123196	正元转02	2,254,390.10	0.16
99	123182	广联转债	2,241,754.08	0.16
100	123228	震裕转债	2,097,178.49	0.15
101	127093	章鼓转债	2,085,193.58	0.15
102	113640	苏利转债	1,880,473.65	0.14
103	123194	百洋转债	1,775,441.26	0.13
104	123189	晓鸣转债	1,759,544.99	0.13
105	113600	新星转债	1,512,701.92	0.11
106	123085	万顺转2	1,333,337.12	0.10
107	127045	牧原转债	1,329,059.63	0.10
108	118008	海优转债	1,242,632.37	0.09
109	123230	金钟转债	1,169,433.77	0.08
110	123132	回盛转债	1,151,812.55	0.08

111	113665	汇通转债	1,145,894.46	0.08
112	127018	本钢转债	833,230.33	0.06
113	123221	力诺转债	792,452.00	0.06
114	113033	利群转债	787,166.73	0.06
115	123208	孩王转债	688,200.50	0.05
116	113649	丰山转债	262,464.46	0.02
117	118029	富淼转债	204,010.92	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

	天弘添利LOF C	天弘添利LOF E
报告期期初基金份额总额	852,037,128.38	300,931,943.72
报告期期间基金总申购份额	73,038,596.04	19,139,704.60
减：报告期期间基金总赎回份额	113,870,167.37	86,920,880.48
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	811,205,557.05	233,150,767.84

§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添利分级债券型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）托管协议
- 4、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）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
二〇二四年十月二十五日