
天弘永利债券型证券投资基金

2024年第4季度报告

2024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:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2025年01月22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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025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2024年10月01日起至2024年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘永利债券			
基金主代码	420002			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2008年04月18日			
报告期末基金份额总额	14,977,600,934.71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	资产配置、固定收益类证券投资策略、权益类证券投资策略。			
业绩比较基准	中债新综合指数。			
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，高于货币市场基金。			
基金管理人	天弘基金管理有限公司			
基金托管人	兴业银行股份有限公司			
下属分级基金的基金简称	天弘永利债券A	天弘永利债券B	天弘永利债券E	天弘永利债券C
下属分级基金的交易代码	420002	420102	002794	009610
报告期末下属分级基金的份额总额	1,389,768,934.99份	11,479,961,517.19份	479,630,485.50份	1,628,239,997.03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10月01日 - 2024年12月31日)			
	天弘永利债券 A	天弘永利债券 B	天弘永利债券 E	天弘永利债券 C
1.本期已实现收益	46,276,044.17	391,096,989.91	16,946,420.64	43,478,471.42
2.本期利润	30,400,256.86	267,719,184.18	12,998,565.34	29,577,765.14
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0205	0.0223	0.0230	0.0191
4.期末基金资产净 值	1,719,271,615. 19	14,261,050,691. 28	549,308,143.2 5	1,813,444,446. 49
5.期末基金份额净 值	1.2371	1.2423	1.1453	1.1137

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

天弘永利债券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	1.70%	0.35%	2.79%	0.09%	-1.09%	0.26%
过去六个月	3.38%	0.32%	3.71%	0.10%	-0.33%	0.22%
过去一年	5.71%	0.27%	7.60%	0.08%	-1.89%	0.19%
过去三年	5.30%	0.22%	16.46%	0.06%	-11.16%	0.16%
过去五年	33.23%	0.27%	26.02%	0.07%	7.21%	0.20%
自基金合同 生效日起至	141.55%	0.20%	104.94%	0.08%	36.61%	0.12%

今						
---	--	--	--	--	--	--

天弘永利债券B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	1.80%	0.35%	2.79%	0.09%	-0.99%	0.26%
过去六个月	3.58%	0.32%	3.71%	0.10%	-0.13%	0.22%
过去一年	6.13%	0.27%	7.60%	0.08%	-1.47%	0.19%
过去三年	6.57%	0.22%	16.46%	0.06%	-9.89%	0.16%
过去五年	35.90%	0.27%	26.02%	0.07%	9.88%	0.20%
自基金合同生效日起至今	158.42%	0.20%	104.94%	0.08%	53.48%	0.12%

天弘永利债券E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	1.80%	0.35%	2.79%	0.09%	-0.99%	0.26%
过去六个月	3.58%	0.32%	3.71%	0.10%	-0.13%	0.22%
过去一年	6.13%	0.27%	7.60%	0.08%	-1.47%	0.19%
过去三年	6.58%	0.22%	16.46%	0.06%	-9.88%	0.16%
过去五年	35.92%	0.27%	26.02%	0.07%	9.90%	0.20%
自基金份额首次确认日起至今	49.13%	0.37%	44.32%	0.07%	4.81%	0.30%

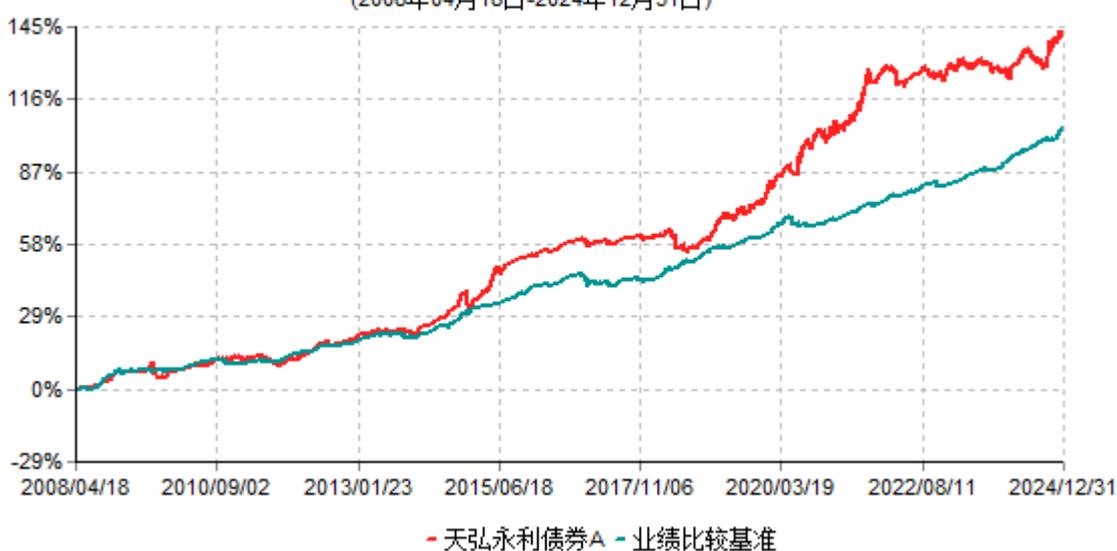
天弘永利债券C净值表现

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	1.73%	0.35%	2.79%	0.09%	-1.06%	0.26%

过去六个月	3.45%	0.32%	3.71%	0.10%	-0.26%	0.22%
过去一年	5.83%	0.27%	7.60%	0.08%	-1.77%	0.19%
过去三年	5.63%	0.22%	16.46%	0.06%	-10.83%	0.16%
自基金份额 首次确认日 起至今	29.93%	0.27%	22.36%	0.06%	7.57%	0.21%

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

天弘永利债券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
(2008年04月18日-2024年12月31日)



天弘永利债券B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2008年04月18日-2024年12月31日)



天弘永利债券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
(2016年05月13日-2024年12月31日)



天弘永利债券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
(2020年05月28日-2024年12月31日)



注：1、本基金合同于2008年04月18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。

3、本基金自2016年05月10日起增设天弘永利债券E基金份额。天弘永利债券E基金份额的首次确认日为2016年05月13日。本基金自2020年05月27日起增设天弘永利债券C基金份额。天弘永利债券C基金份额的首次确认日为2020年05月28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	说明

		任职日期	离任日期	年限	
张寓	本基金基金经理	2021年03月	-	14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。
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、混合资产部部门总经理	2012年08月	-	15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、基金经理助理、宏观研究部部门总经理等。

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遵规守信情况的说明

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0次，未发生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

4季度在政策的提振下，市场信心有恢复，目前是重要的政策观察期。我们延续了之前预定的投资思路，在股票、债券、可转债几类资产上做相对均衡的配置。展望未来，新旧动能切换，意味着宏观经济和资产价格的驱动力和分析框架会发生显著变化，需要保持开放的状态，更多关注内需尤其是消费。后续我们会以财政的着力点为驱动力、以消费为观察指标去分析经济的运行，根据实际情况调整资产配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2024年12月31日，天弘永利债券A基金份额净值为1.2371元，天弘永利债券B基金份额净值为1.2423元，天弘永利债券E基金份额净值为1.1453元，天弘永利债券C基金份额净值为1.1137元。报告期内份额净值增长率天弘永利债券A为1.70%，同期业绩比较基准增长率为2.79%；天弘永利债券B为1.80%，同期业绩比较基准增长率为2.79%；天弘永利债券E为1.80%，同期业绩比较基准增长率为2.79%；天弘永利债券C为1.73%，同期业绩比较基准增长率为2.79%。

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	2,362,766,624.73	10.39
	其中：股票	2,362,766,624.73	10.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,686,546,565.81	86.55
	其中：债券	19,686,546,565.81	86.55
	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	24,001,150.93	0.11
	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	433,321,660.02	1.91
8	其他资产	238,601,830.97	1.05
9	合计	22,745,237,832.46	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	1,146,352,478.23	6.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	568.80	0.00
F	批发和零售业	209,692,749.52	1.14
G	交通运输、仓储和邮政业	517,254,527.28	2.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,350,808.83	0.33
J	金融业	174,782,123.00	0.95
K	房地产业	12,440,160.67	0.07
L	租赁和商务服务业	144,576,168.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	96,317,040.40	0.53
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	2,362,766,624.73	12.88

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	600298	安琪酵母	4,398,700	158,573,135.00	0.86
2	002468	申通快递	14,873,439	150,667,937.07	0.82
3	002179	中航光电	3,815,780	149,960,154.00	0.82
4	601021	春秋航空	2,531,629	145,999,044.43	0.80
5	002027	分众传媒	20,565,600	144,576,168.00	0.79
6	600887	伊利股份	4,754,273	143,483,959.14	0.78
7	600998	九州通	28,016,846	143,446,251.52	0.78
8	601601	中国太保	3,971,100	135,335,088.00	0.74
9	600233	圆通速递	9,087,428	128,950,603.32	0.70
10	000538	云南白药	2,132,660	127,852,967.00	0.70

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	561,653,777.39	3.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,150,154,418.23	33.53
	其中：政策性金融债	1,908,149,347.69	10.40
4	企业债券	7,165,821,169.36	39.07
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	3,375,032,514.44	18.40
7	可转债（可交换债）	2,433,884,686.39	13.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,686,546,565.81	107.32

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	210316	21进出16	8,500,000	886,798,013.70	4.83
2	232480067	24华夏银行永续债02	4,000,000	406,996,865.75	2.22
3	232480012	24农行二级资本债02B	3,200,000	337,215,491.51	1.84
4	185286	22招证G1	3,000,000	306,781,956.15	1.67
5	200405	20农发05	3,000,000	305,747,260.27	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，【国家开发银行】于2024年12月27日收到国家金融监督管理总局北京金融监管局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	1,690,925.75
2	应收证券清算款	200,000,000.00
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	36,910,905.22
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	238,601,830.97

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	118031	天23转债	123,570,800.59	0.67
2	118034	晶能转债	112,549,743.69	0.61
3	127084	柳工转2	102,274,388.56	0.56
4	110075	南航转债	90,421,385.82	0.49
5	113058	友发转债	68,966,656.60	0.38
6	127089	晶澳转债	66,327,089.84	0.36
7	111010	立昂转债	59,668,833.86	0.33
8	128131	崇达转2	49,946,840.20	0.27
9	110095	双良转债	47,531,345.40	0.26
10	110086	精工转债	46,580,153.74	0.25
11	123186	志特转债	45,913,642.35	0.25
12	113048	晶科转债	42,684,563.69	0.23
13	113050	南银转债	42,639,123.67	0.23
14	128081	海亮转债	38,818,661.80	0.21
15	128127	文科转债	35,767,972.55	0.19
16	123149	通裕转债	35,764,284.45	0.19
17	123119	康泰转2	32,777,101.64	0.18
18	118032	建龙转债	32,057,975.21	0.17
19	127068	顺博转债	29,154,659.66	0.16
20	113685	升24转债	28,886,178.48	0.16
21	123236	家联转债	28,862,249.43	0.16
22	127103	东南转债	28,458,960.64	0.16
23	123172	漱玉转债	25,083,716.19	0.14
24	123155	中陆转债	22,750,098.81	0.12

25	127049	希望转2	22,675,758.84	0.12
26	113641	华友转债	22,240,890.13	0.12
27	118024	冠宇转债	21,852,769.06	0.12
28	113661	福22转债	21,133,443.48	0.12
29	113033	利群转债	21,030,641.87	0.11
30	123165	回天转债	20,636,163.61	0.11
31	113605	大参转债	20,448,499.32	0.11
32	111009	盛泰转债	20,210,005.28	0.11
33	118042	奥维转债	19,480,217.20	0.11
34	113653	永22转债	18,590,225.38	0.10
35	127060	湘佳转债	18,276,700.62	0.10
36	111004	明新转债	18,140,486.14	0.10
37	127078	优彩转债	17,918,545.45	0.10
38	127050	麒麟转债	16,503,153.19	0.09
39	123200	海泰转债	16,121,576.49	0.09
40	113676	荣23转债	15,718,105.93	0.09
41	123185	能辉转债	15,423,882.70	0.08
42	127034	绿茵转债	14,837,968.70	0.08
43	113625	江山转债	14,630,784.74	0.08
44	110085	通22转债	14,375,268.22	0.08
45	123146	中环转2	13,972,612.67	0.08
46	123215	铭利转债	13,823,568.99	0.08
47	113675	新23转债	13,812,866.82	0.08
48	128144	利民转债	13,603,732.71	0.07
49	123216	科顺转债	13,517,239.61	0.07
50	118014	高测转债	13,111,585.86	0.07
51	123151	康医转债	13,058,364.53	0.07
52	127086	恒邦转债	12,979,248.05	0.07
53	113681	XD镇洋转	12,891,837.60	0.07
54	113064	东材转债	12,841,896.70	0.07
55	127040	国泰转债	12,748,516.73	0.07
56	123064	万孚转债	12,678,580.46	0.07
57	123171	共同转债	11,849,858.91	0.06

58	123230	金钟转债	11,040,475.66	0.06
59	118022	锂科转债	10,731,263.40	0.06
60	113647	禾丰转债	10,460,636.01	0.06
61	127070	大中转债	10,339,055.74	0.06
62	113545	金能转债	10,290,014.66	0.06
63	123182	广联转债	10,277,547.95	0.06
64	127100	神码转债	10,225,764.38	0.06
65	127059	永东转2	10,087,735.49	0.05
66	123194	百洋转债	9,932,306.34	0.05
67	118009	华锐转债	9,821,504.84	0.05
68	123193	海能转债	9,787,152.56	0.05
69	123174	精锻转债	9,601,657.56	0.05
70	127020	中金转债	9,260,614.49	0.05
71	118035	国力转债	9,218,002.14	0.05
72	113061	拓普转债	9,002,284.66	0.05
73	110089	兴发转债	8,780,415.48	0.05
74	113627	太平转债	8,777,717.35	0.05
75	113644	艾迪转债	8,601,946.07	0.05
76	118011	银微转债	8,299,211.24	0.05
77	113640	苏利转债	8,216,658.64	0.04
78	123180	浙矿转债	8,214,938.86	0.04
79	123233	凯盛转债	7,685,925.21	0.04
80	113563	柳药转债	7,664,682.14	0.04
81	123120	隆华转债	7,600,413.70	0.04
82	123179	立高转债	7,511,452.20	0.04
83	123154	火星转债	6,929,393.29	0.04
84	111016	神通转债	6,921,364.62	0.04
85	127026	超声转债	6,427,281.12	0.04
86	128130	景兴转债	6,370,897.29	0.03
87	123126	瑞丰转债	6,147,657.68	0.03
88	123132	回盛转债	6,097,527.64	0.03
89	118040	宏微转债	5,845,845.32	0.03
90	127041	弘亚转债	5,816,126.57	0.03

91	127099	盛航转债	5,775,271.82	0.03
92	123188	水羊转债	5,760,738.65	0.03
93	113666	爱玛转债	5,651,953.73	0.03
94	113643	风语转债	5,641,404.11	0.03
95	118038	金宏转债	5,632,734.57	0.03
96	110082	宏发转债	5,559,853.28	0.03
97	123196	正元转02	5,515,689.87	0.03
98	113648	巨星转债	5,439,789.42	0.03
99	113609	永安转债	5,294,045.75	0.03
100	123076	强力转债	5,293,941.58	0.03
101	111018	华康转债	5,286,304.89	0.03
102	110079	杭银转债	5,163,647.12	0.03
103	113631	皖天转债	5,098,323.62	0.03
104	127085	韵达转债	5,098,028.06	0.03
105	113679	芯能转债	5,042,607.45	0.03
106	123104	卫宁转债	4,934,178.12	0.03
107	113656	嘉诚转债	4,779,510.68	0.03
108	113054	绿动转债	4,714,931.77	0.03
109	128116	瑞达转债	4,694,769.88	0.03
110	127098	欧晶转债	4,690,975.57	0.03
111	123168	惠云转债	4,690,493.48	0.03
112	113663	新化转债	4,587,118.57	0.03
113	113649	丰山转债	4,310,966.91	0.02
114	123145	药石转债	4,310,032.65	0.02
115	123173	恒锋转债	4,218,556.87	0.02
116	113606	荣泰转债	4,190,072.60	0.02
117	110093	神马转债	4,175,256.01	0.02
118	128133	奇正转债	4,114,689.97	0.02
119	113655	欧22转债	3,613,654.72	0.02
120	118041	星球转债	3,598,515.44	0.02
121	113657	再22转债	3,507,267.10	0.02
122	113670	金23转债	3,433,963.65	0.02
123	118015	芯海转债	3,169,953.53	0.02

124	110076	华海转债	3,071,118.74	0.02
125	123240	楚天转债	2,775,512.73	0.02
126	113682	益丰转债	2,688,719.28	0.01
127	113680	丽岛转债	2,608,547.21	0.01
128	118043	福立转债	2,599,557.16	0.01
129	113043	财通转债	2,505,410.81	0.01
130	127090	兴瑞转债	2,262,619.64	0.01
131	127062	垒知转债	2,233,074.64	0.01
132	123082	北陆转债	2,153,748.40	0.01
133	113045	环旭转债	2,144,162.20	0.01
134	127105	龙星转债	2,131,627.83	0.01
135	113636	甬金转债	2,085,493.24	0.01
136	118029	富淼转债	2,031,474.12	0.01
137	128121	宏川转债	2,027,502.70	0.01
138	123197	光力转债	2,007,193.73	0.01
139	128125	华阳转债	1,845,301.55	0.01
140	127079	华亚转债	1,771,470.40	0.01
141	123124	晶瑞转2	1,739,407.62	0.01
142	123199	山河转债	1,658,876.13	0.01
143	123159	崧盛转债	1,655,556.50	0.01
144	127067	恒逸转2	1,602,634.36	0.01
145	111015	东亚转债	1,581,694.66	0.01
146	128097	奥佳转债	1,551,682.00	0.01
147	123133	佩蒂转债	1,510,472.41	0.01
148	123189	晓鸣转债	1,476,961.07	0.01
149	127042	嘉美转债	1,410,974.70	0.01
150	123122	富瀚转债	1,409,252.21	0.01
151	113624	正川转债	1,404,724.11	0.01
152	113650	博22转债	1,389,813.95	0.01
153	113660	寿22转债	1,278,416.48	0.01
154	123071	天能转债	1,222,068.82	0.01
155	123217	富仕转债	1,075,185.60	0.01
156	123214	东宝转债	1,047,868.66	0.01

157	118033	华特转债	1,045,236.81	0.01
158	127094	红墙转债	943,939.16	0.01
159	123113	仙乐转债	869,546.22	0.00
160	123108	乐普转2	789,070.29	0.00
161	123144	裕兴转债	749,716.00	0.00
162	118036	力合转债	713,553.33	0.00
163	123212	立中转债	696,326.01	0.00
164	113654	永02转债	683,134.42	0.00
165	123085	万顺转2	680,019.95	0.00
166	111005	富春转债	679,149.55	0.00
167	113059	福莱转债	673,259.31	0.00
168	127077	华宏转债	632,896.47	0.00
169	113638	XD台21转	521,551.17	0.00
170	118010	洁特转债	482,743.17	0.00
171	113664	大元转债	368,704.27	0.00
172	118006	阿拉转债	356,950.62	0.00
173	123210	信服转债	330,781.47	0.00
174	127046	百润转债	273,597.70	0.00
175	110094	众和转债	48,272.80	0.00
176	127055	精装转债	34,980.13	0.00
177	123178	花园转债	1,849.05	0.00
178	123142	申昊转债	1,747.25	0.00
179	123232	金现转债	1,720.58	0.00
180	123138	丝路转债	1,457.67	0.00
181	127076	中宠转2	1,342.99	0.00
182	128109	楚江转债	1,281.44	0.00
183	123093	金陵转债	1,230.02	0.00
184	128117	道恩转债	701.47	0.00
185	127073	天赐转债	558.93	0.00
186	127088	赫达转债	455.24	0.00

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

	天弘永利债券 A	天弘永利债券 B	天弘永利债券 E	天弘永利债券 C
报告期期初基金份额总额	1,620,018,381. 15	13,055,454,05 4.58	714,134,137.8 5	1,483,022,250. 20
报告期期间基金总申购份额	162,248,106.5 6	1,563,873,180. 26	68,393,163.61	788,339,386.6 7
减：报告期期间基金总赎回份额	392,497,552.7 2	3,139,365,717. 65	302,896,815.9 6	643,121,639.8 4
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	1,389,768,934. 99	11,479,961,51 7.19	479,630,485.5 0	1,628,239,997. 03

§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

	天弘永利 债券A	天弘永利 债券B	天弘永利 债券E	天弘永利 债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	66,938,97 4.93	-	-
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	-	66,938,97 4.93	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	0.58	-	-

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 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，黄辰立先生担任公司董事长，韩歆毅先生不再担任公司董事长，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董事长变更的公告》。

本报告期内，熊军先生不再担任公司副总经理，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》。

§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债券型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘永利债券型证券投资基金基金合同
- 3、天弘永利债券型证券投资基金托管协议
- 4、天弘永利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

天弘基金管理有限公司
二〇二五年一月二十二日