

# 天弘增强回报债券型证券投资基金

## 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:中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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           | 天弘增强回报   |              |               |
| 基金主代码          | 007128   |              |               |
| 基金运作方式         | 契约型开放式   |              |               |
| 基金合同生效日        | 2019年05月29日  |              |               |
| 报告期末基金份额总额     | 9,392,401,027.54份  |              |               |
| 投资目标           | 本基金主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |              |               |
| 投资策略           | 主要投资策略有：资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略、衍生产品投资策略。                  |              |               |
| 业绩比较基准         | 中债综合全价指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%                               |              |               |
| 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。                   |              |               |
| 基金管理人          | 天弘基金管理有限公司   |              |               |
| 基金托管人          | 中国银行股份有限公司   |              |               |
| 下属分级基金的基金简称    | 天弘增强回报A  | 天弘增强回报C      | 天弘增强回报E       |
| 下属分级基金的交易代码    | 007128   | 007129       | 009735        |
| 报告期末下属分级基金的份额总 | 4,688,623,66   | 4,423,360,82 | 280,416,530.0 |

|   |       |       |    |
|---|-------|-------|----|
| 额 | 9.14份 | 8.39份 | 1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) |                  |                |
|-----------------|--------------------------------|------------------|----------------|
|                 | 天弘增强回报A                        | 天弘增强回报C          | 天弘增强回报E        |
| 1. 本期已实现收益      | -41,889,081.78                 | -42,355,736.58   | -4,200,948.12  |
| 2. 本期利润         | 101,663,391.54                 | 82,826,138.12    | 2,142,323.60   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0197                         | 0.0180           | 0.0044         |
| 4. 期末基金资产净值     | 6,326,701,662.83               | 5,895,629,606.03 | 337,206,681.71 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.3494                         | 1.3328           | 1.2025         |

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

天弘增强回报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           | 1.64%  | 0.26%     | 1.55%      | 0.28%         | 0.09%  | -0.02% |
| 过去六个月           | -3.13% | 0.34%     | -1.42%     | 0.29%         | -1.71% | 0.05%  |
| 过去一年            | 3.68%  | 0.33%     | -1.29%     | 0.25%         | 4.97%  | 0.08%  |
| 过去三年            | 34.44% | 0.34%     | 7.16%      | 0.25%         | 27.28% | 0.09%  |
| 自基金合同生效日起至<br>今 | 34.94% | 0.33%     | 8.40%      | 0.25%         | 26.54% | 0.08%  |

## 天弘增强回报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           | 1.54%  | 0.26%     | 1.55%      | 0.28%         | -0.01% | -0.02% |
| 过去六个月           | -3.32% | 0.34%     | -1.42%     | 0.29%         | -1.90% | 0.05%  |
| 过去一年            | 3.26%  | 0.33%     | -1.29%     | 0.25%         | 4.55%  | 0.08%  |
| 过去三年            | 32.84% | 0.34%     | 7.16%      | 0.25%         | 25.68% | 0.09%  |
| 自基金合同生效日起至<br>今 | 33.28% | 0.33%     | 8.40%      | 0.25%         | 24.88% | 0.08%  |

## 天弘增强回报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             | 1.56%  | 0.26%     | 1.55%      | 0.28%         | 0.01%  | -0.02% |
| 过去六个月             | -3.27% | 0.34%     | -1.42%     | 0.29%         | -1.85% | 0.05%  |
| 过去一年              | 3.37%  | 0.33%     | -1.29%     | 0.25%         | 4.66%  | 0.08%  |
| 自基金份额首次确认日<br>起至今 | 20.25% | 0.37%     | 4.12%      | 0.26%         | 16.13% | 0.11%  |

## 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

天弘增强回报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

(2019年05月29日-2022年06月30日)



天弘增强回报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

(2019年05月29日-2022年06月30日)



天弘增强回报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



注：1、本基金合同于2019年05月29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2020年06月12日起增设天弘增强回报E基金份额。天弘增强回报E基金份额的首次确认日为2020年06月15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 |        |  |
| 彭玮 | 本基金基金经理 | 2021年09月    | -    | 5年     | 男，金融专业硕士。历任渤海证券股份有限公司交易助理、渤海汇金证券资产管理有限公司投资经理助理。2019年7月加盟本公司。 |
| 张寓 | 本基金基金经理 | 2020年07     | -    | 12年    | 男，金融学硕士。历任建信基金管理有限责任公司                                       |

|     |  |          |   |     |  |
|-----|--|----------|---|-----|--|
|     |  | 月        |   |     | 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、宏观研究部、混合资产部总经理 | 2019年05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。 |

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

二季度债券市场仍然以震荡市为主，缺少趋势交易机会，本组合以2年左右久期的杠杆策略套息为主，辅以部分长久期利率债灵活做波段交易。宏观层面在预期层面扰动金融资产价格变化，受疫情影响，经济表现较弱，货币政策随即维持了较为宽松的货币环境，提升了债券资产杠杆策略收益。而在机构行为方面，居民理财需求旺盛，不过风险偏好略有降低，因此对于债券类资产有一定估值支撑力量，值得一提的是，债券市场的传统配置机构——银行体系二季度配置债券的动力不高，因此债券没有走出趋势性行情，而活跃交易盘则在极其狭窄的区间做存量博弈行情。

二季度以来，市场从底部走出来，经历了一轮快速的反弹。这轮反弹主要表现在成长股领域，围绕“能源切换”的领域进行，包括：新的能源生产端的新能源设备、旧的能源生产者如煤炭；能源的消耗端在围绕车这个大的载体进行，如汽车零配件、整车、锂电池产业链等。目前，这类板块的机构配置比例、板块成交比例，经我们估算均以达到很高的状态，围绕这些领域的泛新能源标的，成为市场最为追逐的热点之一。

对于这些板块，我们认为其引领着中国的产业变革，甚至全球的能源变革，承载了梦想，成为时代的最强音，也孕育了很多投资机会。但硬币也有反过来一面，数据表示，这个领域的投资拥挤度已经达到非常高的水平。而我们从绝对收益的角度出发，认为市场配置的比例失衡往往会孕育一些风险，在考虑风险控制的因素后，我们考虑持有一部分中长期价值相对确定的公司，作为行业性配置，但会去控制这部分的仓位，将投资性价比摆在更重要的位置，在性价比缺失的地方也需要适度规避。

对于非热门板块的行业和资产标的，我们认为经过了年初的下跌，很多标的进入了较合适的配置区间，其价值处于低估状态，虽然整体市场的估值还并没有达到极端极值的状态。从中长期角度来看，我们认为这种配置有望带来相对更加确定的收益，所以对于这些板块，我们保持了较多比例的配置。如金融地产、建筑建材、中游制造、化工、银行，市场对经济的分歧导致目前这些板块的估值和隐含的预期都处于相对底部的状态。如一些成长性和估值匹配的个股，在非热门状态下资金光顾较少，落在了较低的估值水平上无人问津。此外，在成长股板块，我们依然认为军工、绿电是相对具有稳健的业绩兑现能力同时增长性也可衡量的板块，具备可推演peg的价值。在这些非热点区域，我们认为还可以找到具备投资性价比的地方。

展望未来，我们认为市场仍处于波动较大的阶段，波动性没有完全收敛。而经济情况未来面临一系列的变数，市场最为关注的全球和国内的流动性和通胀的问题也处于微妙的变化状态，市场或面临较多不确定性，让我们认为还是应当适当谨慎，配置一些确定性更高的标的和板块，寻找绝对收益来源。

在控制回撤方面，一季度市场较多突发因素造成的波动，坦率来说给我们带来了很大的困难，因为作为类绝对收益产品，我们依然认为固收+类产品需要具备“下有底”的风险可控能力，在市场波动的时候我们需要尽量控制仓位来应对风险，这会对收益产生一定的影响，但换来的是万一市场风险失控我们的产品不失控。风险解除后，我们再



衡量经济、流动性、行业景气度、公司业绩实现能力、估值等各方面风险收益特征合适时，适当提高仓位。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2022年06月30日，天弘增强回报A基金份额净值为1.3494元，天弘增强回报C基金份额净值为1.3328元，天弘增强回报E基金份额净值为1.2025元。报告期内份额净值增长率天弘增强回报A为1.64%，同期业绩比较基准增长率为1.55%；天弘增强回报C为1.54%，同期业绩比较基准增长率为1.55%；天弘增强回报E为1.56%，同期业绩比较基准增长率为1.55%。

#### 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<br>(%) |
|----|-------------------|-------------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 1,620,416,569.02  | 9.92             |
|    | 其中：股票             | 1,620,416,569.02  | 9.92             |
| 2  | 基金投资              | -                 | -                |
| 3  | 固定收益投资            | 13,715,352,919.41 | 83.99            |
|    | 其中：债券             | 13,715,352,919.41 | 83.99            |
|    | 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      | 585,072,855.47    | 3.58             |
| 8  | 其他资产              | 408,255,080.05    | 2.50             |
| 9  | 合计                | 16,329,097,423.95 | 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              | 10,030,627.02    | 0.08  |
| C | 制造业              | 879,000,070.47   | 7.00  |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 146,008,294.96   | 1.16  |
| E | 建筑业              | 152,360,587.93   | 1.21  |
| F | 批发和零售业           | -                | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -                | -     |
| H | 住宿和餐饮业           | 37,526,140.00    | 0.30  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 27,005,748.00    | 0.22  |
| J | 金融业              | 174,079,881.00   | 1.39  |
| K | 房地产业             | 146,496,266.00   | 1.17  |
| L | 租赁和商务服务业         | 26,266,517.00    | 0.21  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 21,642,436.64    | 0.17  |
| 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               | 1,620,416,569.02 | 12.90 |

### 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  | 603601 | 再升科技 | 17,865,646 | 113,625,508.56 | 0.90         |
| 2  | 600039 | 四川路桥 | 9,508,815  | 100,127,821.95 | 0.80         |
| 3  | 600048 | 保利发展 | 5,138,400  | 89,716,464.00  | 0.71         |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 3,362,300  | 66,909,770.00  | 0.53         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 5  | 601012 | 隆基绿能 | 901,142   | 60,043,091.46 | 0.48 |
| 6  | 600011 | 华能国际 | 7,104,200 | 50,013,568.00 | 0.40 |
| 7  | 002271 | 东方雨虹 | 951,000   | 48,947,970.00 | 0.39 |
| 8  | 601985 | 中国核电 | 6,724,800 | 46,132,128.00 | 0.37 |
| 9  | 688021 | 奥福环保 | 1,305,979 | 43,293,203.85 | 0.34 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 1,552,180 | 39,425,372.00 | 0.31 |

#### 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      | 654,481,956.90    | 5.21         |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 3,830,062,005.47  | 30.50        |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,026,581,912.33  | 16.14        |
| 4  | 企业债券      | 6,754,533,034.31  | 53.78        |
| 5  | 企业短期融资券   | 50,791,410.96     | 0.40         |
| 6  | 中期票据      | 1,236,454,579.15  | 9.84         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,189,029,932.62  | 9.47         |
| 8  | 同业存单      | -                 | -            |
| 9  | 其他        | -                 | -            |
| 10 | 合计        | 13,715,352,919.41 | 109.20       |

#### 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  | 210215  | 21国开15    | 8,100,000 | 829,905,361.64 | 6.61         |
| 2  | 210005  | 21付息国债05  | 3,100,000 | 333,290,655.74 | 2.65         |
| 3  | 2128041 | 21广发银行小微债 | 3,000,000 | 307,672,586.30 | 2.45         |
| 4  | 188987  | 21京投03    | 2,700,000 | 275,884,402.19 | 2.20         |
| 5  | 188736  | 21国君12    | 2,300,000 | 236,533,903.02 | 1.88         |

#### 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；【国家开发银行】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；【交通银行股份有限公司】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，于2021年08月13日收到中国人民银行出具公开处罚的通报；【平安银行股份有限公司】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；【兴业银行股份有限公司】于2021年08月13日收到中国人民银行出具公开处罚的通报，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；【中信证券股份有限公司】于2021年11月22日收到国家外汇管理局深圳市分局出具罚款处罚、没收违法所得、责令改正的通报。

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   | 724,033.28     |
| 2  | 应收证券清算款 | 388,010,001.16 |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | -              |
| 5  | 应收申购款   | 19,521,045.61  |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 408,255,080.05 |

## 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 | 88,102,207.45 | 0.70         |
| 2  | 127045 | 牧原转债 | 59,033,420.78 | 0.47         |
| 3  | 113615 | 金诚转债 | 44,860,514.64 | 0.36         |
| 4  | 110072 | 广汇转债 | 44,355,881.49 | 0.35         |
| 5  | 113011 | 光大转债 | 36,245,231.37 | 0.29         |
| 6  | 127049 | 希望转2 | 34,730,544.66 | 0.28         |
| 7  | 110053 | 苏银转债 | 33,400,939.39 | 0.27         |
| 8  | 128109 | 楚江转债 | 28,414,048.67 | 0.23         |
| 9  | 113610 | 灵康转债 | 28,395,761.31 | 0.23         |
| 10 | 128108 | 蓝帆转债 | 27,161,059.65 | 0.22         |
| 11 | 123128 | 首华转债 | 26,524,993.60 | 0.21         |
| 12 | 113530 | 大丰转债 | 26,508,940.69 | 0.21         |
| 13 | 110047 | 山鹰转债 | 26,482,412.23 | 0.21         |
| 14 | 127033 | 中装转2 | 26,147,785.98 | 0.21         |
| 15 | 128083 | 新北转债 | 26,060,109.59 | 0.21         |
| 16 | 123132 | 回盛转债 | 25,310,633.10 | 0.20         |
| 17 | 127027 | 靖远转债 | 23,647,513.42 | 0.19         |
| 18 | 128106 | 华统转债 | 23,283,727.67 | 0.19         |
| 19 | 113593 | 沪工转债 | 22,109,352.60 | 0.18         |
| 20 | 127030 | 盛虹转债 | 20,485,211.23 | 0.16         |
| 21 | 128074 | 游族转债 | 18,553,029.21 | 0.15         |
| 22 | 128128 | 齐翔转2 | 18,095,309.59 | 0.14         |
| 23 | 127018 | 本钢转债 | 17,885,920.89 | 0.14         |
| 24 | 127028 | 英特转债 | 17,871,525.76 | 0.14         |
| 25 | 128105 | 长集转债 | 17,705,574.12 | 0.14         |
| 26 | 123125 | 元力转债 | 17,027,903.92 | 0.14         |
| 27 | 110075 | 南航转债 | 16,780,448.22 | 0.13         |
| 28 | 128063 | 未来转债 | 15,320,197.26 | 0.12         |
| 29 | 123063 | 大禹转债 | 13,797,100.01 | 0.11         |
| 30 | 128129 | 青农转债 | 11,926,522.27 | 0.09         |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 31 | 128081 | 海亮转债  | 11,881,711.55 | 0.09 |
| 32 | 128127 | 文科转债  | 11,727,391.04 | 0.09 |
| 33 | 127029 | 中钢转债  | 11,538,861.34 | 0.09 |
| 34 | 113623 | 凤21转债 | 11,472,205.48 | 0.09 |
| 35 | 128130 | 景兴转债  | 11,182,748.50 | 0.09 |
| 36 | 113025 | 明泰转债  | 10,966,066.85 | 0.09 |
| 37 | 113033 | 利群转债  | 10,085,018.30 | 0.08 |
| 38 | 123056 | 雪榕转债  | 9,941,347.39  | 0.08 |
| 39 | 110081 | 闻泰转债  | 9,323,803.18  | 0.07 |
| 40 | 128034 | 江银转债  | 9,278,490.31  | 0.07 |
| 41 | 123044 | 红相转债  | 8,997,410.80  | 0.07 |
| 42 | 127020 | 中金转债  | 8,890,538.29  | 0.07 |
| 43 | 123085 | 万顺转2  | 7,263,084.93  | 0.06 |
| 44 | 113594 | 淳中转债  | 7,188,884.28  | 0.06 |
| 45 | 128022 | 众信转债  | 7,129,349.32  | 0.06 |
| 46 | 113042 | 上银转债  | 6,365,460.93  | 0.05 |
| 47 | 123049 | 维尔转债  | 5,687,446.22  | 0.05 |
| 48 | 113602 | 景20转债 | 5,500,312.93  | 0.04 |
| 49 | 113598 | 法兰转债  | 5,222,695.89  | 0.04 |
| 50 | 123105 | 拓尔转债  | 4,934,213.67  | 0.04 |
| 51 | 128138 | 侨银转债  | 4,569,217.68  | 0.04 |
| 52 | 113624 | 正川转债  | 4,262,967.52  | 0.03 |
| 53 | 128125 | 华阳转债  | 4,207,427.55  | 0.03 |
| 54 | 110077 | 洪城转债  | 3,926,565.21  | 0.03 |
| 55 | 127022 | 恒逸转债  | 3,812,585.75  | 0.03 |
| 56 | 110063 | 鹰19转债 | 3,739,566.05  | 0.03 |
| 57 | 123113 | 仙乐转债  | 3,538,485.44  | 0.03 |
| 58 | 113591 | 胜达转债  | 3,397,224.60  | 0.03 |
| 59 | 128118 | 瀛通转债  | 3,132,197.63  | 0.02 |
| 60 | 113601 | 塞力转债  | 2,792,612.27  | 0.02 |
| 61 | 127015 | 希望转债  | 2,418,805.66  | 0.02 |
| 62 | 123126 | 瑞丰转债  | 1,970,983.15  | 0.02 |
| 63 | 113045 | 环旭转债  | 882,602.68    | 0.01 |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 64 | 128120 | 联诚转债 | 275,198.82 | 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

|                           | 天弘增强回报A          | 天弘增强回报C          | 天弘增强回报E        |
|---------------------------|------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 5,540,956,459.64 | 4,931,306,575.55 | 702,623,424.42 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 60,364,733.81    | 548,427,713.78   | 10,003,761.12  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 912,697,524.31   | 1,056,373,460.94 | 432,210,655.53 |
| 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               | 4,688,623,669.14 | 4,423,360,828.39 | 280,416,530.01 |

### § 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，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定，调整了本基金在基金销售机构及直销机构的单笔最低申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额，并于2022年4月15日生效。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调整旗下部分基金在基金销售机构及直销机构的单笔最低申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额的公告》。

## §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增强回报债券型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘增强回报债券型证券投资基金基金合同
- 3、天弘增强回报债券型证券投资基金托管协议
- 4、天弘增强回报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住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](http://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