

# 天弘增强回报债券型证券投资基金

## 2022年第4季度报告

2022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:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2023年01月28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2023年01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10月01日起至2022年12月31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	6,996,531,554.07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额	3,366,734,752.4 6份	3,309,372,035.1 9份	320,424,766.42 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10月01日 - 2022年12月31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	-5,455,481.50	-9,289,228.45	-681,660.85
2.本期利润	-15,654,476.36	-18,575,892.01	-2,173,243.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0042	-0.0053	-0.0069
4.期末基金资产净值	4,438,700,382.14	4,300,899,044.16	375,899,048.30
5.期末基金份额净值	1.3184	1.2996	1.1731

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	-0.37%	0.33%	-0.05%	0.25%	-0.32%	0.08%
过去六个月	-2.30%	0.28%	-2.68%	0.21%	0.38%	0.07%
过去一年	-5.36%	0.31%	-4.06%	0.26%	-1.30%	0.05%
过去三年	24.64%	0.35%	1.92%	0.25%	22.72%	0.10%
自基金合同生效日起至	31.84%	0.32%	5.50%	0.24%	26.34%	0.08%

今						
---	--	--	--	--	--	--

## 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	-0.47%	0.33%	-0.05%	0.25%	-0.42%	0.08%
过去六个月	-2.49%	0.28%	-2.68%	0.21%	0.19%	0.07%
过去一年	-5.73%	0.31%	-4.06%	0.26%	-1.67%	0.05%
过去三年	23.15%	0.35%	1.92%	0.25%	21.23%	0.10%
自基金合同生效日起至 今	29.96%	0.32%	5.50%	0.24%	24.46%	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	-0.45%	0.33%	-0.05%	0.25%	-0.40%	0.08%
过去六个月	-2.44%	0.28%	-2.68%	0.21%	0.24%	0.07%
过去一年	-5.64%	0.31%	-4.06%	0.26%	-1.58%	0.05%
自基金份额首次确认日 起至今	17.31%	0.36%	1.33%	0.25%	15.98%	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12月31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12月31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。
姜晓丽	固定收益业务	2019年05	-	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

	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	月			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2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

4季度政策层面的变化，对市场产生了根本性的影响：在全面恢复正常化后，除了消费、生产、生活等各方面将逐步恢复到正常的状态以外，相应的不确定性风险大幅度降低，这对整个市场的预期和估值体系，都有了根本性的改变。另外，地产政策的改变，对整个经济的走向也产生了根本性的影响：之前所担心的地产和相关金融体系的风险，在政策改变的框架下，得到托底和修复，这将对未来一段时间经济的企稳贡献重要的托底力量。在这两个极为重要变量发生根本性的变化的背景下，我们对市场的判断也由之前的中性和震荡，转为战略性看好权益市场。当然未来大概率还会存在一些反复的情形，包括疫情扩散后的次生问题，以及经济体恢复需要时间和恢复力度强弱的问题等等，但我们认为从中长期维度经济和市场逐步走出阴霾是大概率事件。

但这个过程也相对复杂。我们知道目前国内的经济结构和国际形势，都与以往有较大不同，这对我们的分析框架和理解范式都提出了新的要求。经济中重要的行业目前仍处于困境复苏的状态，但复苏的力度有多强以及稳定性延续性，这些都需要保持跟踪。如果说全面恢复后，经济就能回到之前强劲的状态，我们认为还是存疑。这包括：目前经济运行的库存偏高和需求偏弱，在没有强力拉动的情形下，经济整体要走出“去库存”的周期，还需要一定的时间；另一个是出口目前处于相对弱的状态，过去两年强力的出口对经济有较强的带动作用，而目前出口的走弱以及海外经济下行的不确定性，给出口拉动因素蒙上了一些阴影；地产在政策的支持下，企业主体端会救助，而市场端我们看到在2022年下半年，尤其是断贷事件发酵下，新屋销售环比保持了没有下滑，而二手房的销量也比较稳，加上居民端储蓄率的大幅上升，我们认为居民的购房能力和目前购房的意愿都是有底的，但好转起来能上升多少幅度，还需要再做跟踪和研判，但底部特征已经具备。在这些因素的交织下，我们认为未来一段时间，好的因素和不好的因素交织，可能使得经济复苏的步伐不像我们直接想象的那么直接和线性。

对于市场，我们认为可以更加乐观一些，因为之前我们列为重点风险的几个点，已经有以上两个大的风险得到了改变。资本市场是聪明和领先的，预期领先于现实，未来实体经济的逐步修复过程，将穿插着信心层面和现实层面的交叉互验上升，如果进一步看到居民和企业家信心的改善，居民重新加大支出力度而非储蓄、企业家加大投资和创新都是可以预期的，这将带来经济的重新上行，以及风险偏好的改善。

4季度我们进一步提高了仓位，配置上相对均衡一些。加仓了金融和地产链的相关标的，我们认为在地产政策的转向下，地产企业端的风险得到了释放，而销售端虽然仍然维持低位，但在较大的宏观压力下数据上也表现出来没有继续下滑的迹象，行业或已经在底部状态；而地产问题的改善，也带来金融体系资产端的风险释放，对于地产链和金融行业，未来具备竞争格局上有优势并且能够维持的标的，我们认为可以现在可以做相对长期的配置考量。此外，经历较长时间的市场下行，已经有较多价值类的标的处于历史估值的低位，而政策的全面转向和经济未来见底回升的预期，也带来这些标的有可能进入困境反转的境地，在这块我们也进行了加仓。而之前我们所持有的一些成长类或者稳定类的标的，我们继续持有，少量做了一些调换，对过去两年预期已经走向高度一



致，并且产业趋势有一些变化的地方，我们认为需要更多的跟踪和研究的迭代，包括传统的赛道以及创新。在供需格局，产业竞争格局有可能变化的地步，我们认为需要审慎对待，重点考虑调整后的风险收益比，仓位上注意防范风险。避开过于一致预期，并且在研判的假设上本身存在不确定性的行业和个股。

四季度，债券市场下跌的风险逐步兑现。经历了10月一波短暂的被动补仓位行情之后，我们依然保持在较低的仓位和保守的久期状态，进入11月初，随着各类政策出台，宏观经济的预期短期内快速抬升，债券市场由于整体估值贵，部分趋势交易者开始离场，同时做市商增加了额外的对冲套保需求，而到了11月中旬，由于公募基金和理财子公司的短债策略拥挤，负反馈效应持续，导致各类债券类产品回撤较大，直到12月中旬，负反馈过程才得到缓解。

我们在四季度始终保持了谨慎的仓位和久期，抵御了市场的下跌冲击，主动控制了回撤，而站在目前的时间点，我们认为信用债整体估值大幅修复之后具有良好的配置价值，但利率债仍然保持着中性甚至偏贵的估值状态，只能以交易的思路灵活应对。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2022年12月31日，天弘增强回报A基金份额净值为1.3184元，天弘增强回报C基金份额净值为1.2996元，天弘增强回报E基金份额净值为1.1731元。报告期内份额净值增长率天弘增强回报A为-0.37%，同期业绩比较基准增长率为-0.05%；天弘增强回报C为-0.47%，同期业绩比较基准增长率为-0.05%；天弘增强回报E为-0.45%，同期业绩比较基准增长率为-0.05%。

#### 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	1,680,300,707.50	14.21
	其中：股票	1,680,300,707.50	14.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,757,720,509.51	82.52
	其中：债券	9,757,720,509.51	82.52
	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	11,003,399.81	0.09
	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	350,784,611.09	2.97
8	其他资产	24,496,560.48	0.21
9	合计	11,824,305,788.39	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	1,076,595,559.35	11.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,764,962.00	0.71
E	建筑业	76,979,403.84	0.84
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	357,914,534.00	3.93
K	房地产业	77,927,089.91	0.85
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	26,119,158.40	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	1,680,300,707.50	18.43
--	----	------------------	-------

### 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	14,422,766	76,152,204.48	0.84
2	600036	招商银行	1,822,400	67,902,624.00	0.74
3	600039	四川路桥	5,594,115	62,206,558.80	0.68
4	300737	科顺股份	4,587,100	57,705,718.00	0.63
5	300059	东方财富	2,819,880	54,705,672.00	0.60
6	300408	三环集团	1,775,062	54,512,154.02	0.60
7	300033	同花顺	550,300	54,265,083.00	0.60
8	600486	扬农化工	508,000	52,781,200.00	0.58
9	002415	海康威视	1,490,800	51,700,944.00	0.57
10	601012	隆基绿能	1,096,782	46,350,007.32	0.51

### 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	303,188,731.52	3.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	264,681,156.17	2.90
	其中：政策性金融债	264,681,156.17	2.90
4	企业债券	6,665,225,053.76	73.12
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	623,683,393.41	6.84
7	可转债（可交换债）	1,900,942,174.65	20.85
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,757,720,509.51	107.05

注:可转债项下包含可交换债76,834,653.08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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净
---	------	------	-------	---------	--------

号					值比例 (%)
1	188987	21京投03	2,700,000	271,289,342.48	2.98
2	188736	21国君12	2,300,000	232,380,468.49	2.55
3	188751	21中证14	2,100,000	212,083,878.91	2.33
4	185238	22京投01	2,000,000	203,943,616.44	2.24
5	188813	21中证16	2,000,000	201,706,794.52	2.21

**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，【国信证券股份有限公司】于2022年02月11日收到中国人民银行深圳市中心支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	673,453.24
2	应收证券清算款	23,101,287.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	721,820.24
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	24,496,560.48

#### 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	127045	牧原转债	89,318,729.86	0.98
2	123107	温氏转债	81,006,027.39	0.89
3	127061	美锦转债	77,614,337.89	0.85
4	132018	G三峡EB1	76,834,653.08	0.84
5	123092	天壕转债	65,505,286.30	0.72
6	123128	首华转债	58,689,150.83	0.64
7	110072	广汇转债	55,666,758.45	0.61
8	113640	苏利转债	43,414,636.61	0.48
9	127049	希望转2	40,389,909.62	0.44
10	118004	博瑞转债	39,948,133.64	0.44
11	127063	贵轮转债	36,884,890.88	0.40
12	128108	蓝帆转债	36,679,163.77	0.40
13	127058	科伦转债	36,568,601.55	0.40
14	113060	浙22转债	36,239,432.88	0.40
15	113615	金诚转债	35,167,908.10	0.39
16	113609	永安转债	32,146,708.06	0.35
17	113052	兴业转债	30,544,315.07	0.34
18	128081	海亮转债	30,288,698.63	0.33
19	127051	博杰转债	29,987,769.86	0.33
20	128037	岩土转债	29,175,500.00	0.32
21	113647	禾丰转债	28,434,213.15	0.31
22	127030	盛虹转债	27,620,969.86	0.30
23	113636	甬金转债	26,636,489.04	0.29
24	127052	西子转债	26,177,633.52	0.29
25	128109	楚江转债	24,055,051.90	0.26
26	113610	灵康转债	22,971,317.52	0.25
27	113027	华钰转债	22,358,400.04	0.25
28	128105	长集转债	20,720,508.83	0.23

29	110047	山鹰转债	20,651,350.69	0.23
30	128106	华统转债	17,736,571.23	0.19
31	128074	游族转债	17,439,802.74	0.19
32	113593	沪工转债	17,339,547.67	0.19
33	123109	昌红转债	16,534,487.94	0.18
34	127033	中装转2	16,530,739.73	0.18
35	118003	华兴转债	16,199,418.43	0.18
36	113641	华友转债	15,494,686.03	0.17
37	113530	大丰转债	15,385,905.82	0.17
38	113622	杭叉转债	15,246,519.02	0.17
39	123056	雪榕转债	15,205,365.37	0.17
40	128063	未来转债	13,992,706.85	0.15
41	128140	润建转债	12,926,783.56	0.14
42	127018	本钢转债	12,812,965.75	0.14
43	123044	红相转债	12,514,417.45	0.14
44	113051	节能转债	12,495,008.22	0.14
45	128128	齐翔转2	11,839,832.88	0.13
46	127060	湘佳转债	11,789,265.75	0.13
47	127006	敖东转债	11,724,101.37	0.13
48	110057	现代转债	11,250,410.96	0.12
49	128044	岭南转债	11,017,232.88	0.12
50	113623	凤21转债	10,962,369.86	0.12
51	113601	塞力转债	10,796,150.69	0.12
52	128026	众兴转债	10,051,495.89	0.11
53	113648	巨星转债	9,415,502.65	0.10
54	113504	艾华转债	9,285,068.01	0.10
55	113644	艾迪转债	9,147,869.90	0.10
56	127053	豪美转债	9,126,676.05	0.10
57	113534	鼎胜转债	8,521,434.25	0.09
58	123099	普利转债	8,301,909.86	0.09
59	110081	闻泰转债	8,153,237.63	0.09
60	113039	嘉泽转债	7,718,695.89	0.08
61	127022	恒逸转债	7,594,741.16	0.08

62	110048	福能转债	7,557,931.51	0.08
63	110053	苏银转债	7,423,022.47	0.08
64	123071	天能转债	7,139,255.65	0.08
65	127029	中钢转债	6,933,622.11	0.08
66	127043	川恒转债	6,869,836.99	0.08
67	113626	伯特转债	6,819,715.07	0.07
68	128017	金禾转债	6,780,426.30	0.07
69	113537	文灿转债	6,513,372.60	0.07
70	123049	维尔转债	6,471,256.38	0.07
71	113033	利群转债	6,373,964.38	0.07
72	128083	新北转债	5,897,787.67	0.06
73	127040	国泰转债	5,762,265.35	0.06
74	127059	永东转2	5,666,371.83	0.06
75	113598	法兰转债	5,494,301.37	0.06
76	123082	北陆转债	5,339,810.96	0.06
77	123113	仙乐转债	5,318,898.63	0.06
78	113602	景20转债	4,981,089.64	0.05
79	113025	明泰转债	4,884,690.41	0.05
80	110084	贵燃转债	4,716,219.18	0.05
81	128021	兄弟转债	4,644,165.48	0.05
82	128138	侨银转债	4,530,694.10	0.05
83	127020	中金转债	3,985,672.64	0.04
84	110077	洪城转债	3,674,556.99	0.04
85	123108	乐普转2	3,529,006.85	0.04
86	128042	凯中转债	3,502,845.21	0.04
87	128130	景兴转债	3,400,787.67	0.04
88	113588	润达转债	3,345,119.18	0.04
89	113505	杭电转债	3,325,425.21	0.04
90	113639	华正转债	3,081,297.53	0.03
91	113542	好客转债	2,682,293.83	0.03
92	113570	百达转债	2,408,175.34	0.03
93	127015	希望转债	2,222,351.29	0.02
94	110076	华海转债	2,210,630.14	0.02

95	113011	光大转债	404,845.47	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	4,083,373,928.03	3,743,799,328.17	249,860,805.93
报告期期间基金总申购份额	256,887,466.47	112,905,514.35	100,638,618.11
减：报告期期间基金总赎回份额	973,526,642.04	547,332,807.33	30,074,657.62
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	3,366,734,752.46	3,309,372,035.19	320,424,766.42

## §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、单笔最低追加申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额，并于2022年12月30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、单笔最低追加申购金额、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  
二〇二三年一月二十八日