
天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金

2023年第2季度报告

2023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:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2023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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023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2023年04月01日起至2023年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘弘丰增强回报	
基金主代码	006898	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年03月20日	
报告期末基金份额总额	1,904,276,932.50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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	天弘弘丰增强回报A	天弘弘丰增强回报C
下属分级基金的交易代码	006898	006899
报告期末下属分级基金的份额总	1,178,987,462.39份	725,289,470.11份

额		
---	--	--

§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04月01日 - 2023年06月30日)	
	天弘弘丰增强回报A	天弘弘丰增强回报C
1.本期已实现收益	-1,879,012.07	-2,040,316.66
2.本期利润	-38,990,845.17	-21,173,508.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0357	-0.0319
4.期末基金资产净值	1,371,384,650.70	829,422,633.63
5.期末基金份额净值	1.1632	1.1436

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

天弘弘丰增强回报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	-3.02%	0.71%	-0.28%	0.16%	-2.74%	0.55%
过去六个月	2.21%	0.73%	0.89%	0.16%	1.32%	0.57%
过去一年	-9.91%	0.91%	-1.81%	0.19%	-8.10%	0.72%
过去三年	11.57%	0.87%	1.61%	0.24%	9.96%	0.63%
自基金合同生效日起至 今	16.32%	0.73%	5.23%	0.24%	11.09%	0.49%

天弘弘丰增强回报C净值表现

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	-3.11%	0.71%	-0.28%	0.16%	-2.83%	0.55%
过去六个月	2.02%	0.73%	0.89%	0.16%	1.13%	0.57%
过去一年	-10.26%	0.91%	-1.81%	0.19%	-8.45%	0.72%
过去三年	10.26%	0.87%	1.61%	0.24%	8.65%	0.63%
自基金合同 生效日起至 今	14.36%	0.73%	5.23%	0.24%	9.13%	0.49%

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

天弘弘丰增强回报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03月20日-2023年06月30日)



天弘弘丰增强回报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03月20日-2023年06月30日)

注：1、本基金合同于2019年03月20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		
杜广	本基金基金经理	2020年07月	-	9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

当前位置对权益市场非常乐观，各个组合都有进攻性的提升。

在中美双重去库存的宏观背景下，经济疲弱虽是事实，但市场对经济的体感温度可能已经到了接近0度，与经济有关的板块估值已处于低位，不少传统行业的个股已经跌破重置成本。这意味着只要经济有预期差，这部分股票很有可能带来非常强劲的反弹。前瞻地看，就业压力驱动的稳增长政策可能是潜在的第一个期权；第二期权在于中美库存周期可能于四季度见底，而复盘库存周期与股市的关系，一般股市会略微领先于库存周期见底。

因此在配置方向上，倾向于主力仓位逆势配置与经济有关的方向，包含消费电子、银行、保险、供给侧有大变化的地产链、大消费里面有较多成长属性的个股，另外基于美国地产基本面的韧性和加息周期的逐步见顶，我们也非常看好美国地产链相关的个股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2023年06月30日，天弘弘丰增强回报A基金份额净值为1.1632元，天弘弘丰增强回报C基金份额净值为1.1436元。报告期内份额净值增长率天弘弘丰增强回报A为-3.02%，同期业绩比较基准增长率为-0.28%；天弘弘丰增强回报C为-3.11%，同期业绩比较基准增长率为-0.28%。

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	439,870,480.67	14.96
	其中：股票	439,870,480.67	14.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,456,440,016.25	83.56
	其中：债券	2,456,440,016.25	83.56
	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	43,094,616.58	1.47
8	其他资产	385,669.51	0.01
9	合计	2,939,790,783.01	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	849,030.00	0.04
C	制造业	269,537,023.92	12.25
D	电力、热力、燃气及水生	28,788,781.00	1.31

	产和供应业		
E	建筑业	2,707,560.00	0.12
F	批发和零售业	868,560.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	5,931,166.75	0.27
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	114,920,703.00	5.22
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	714,474.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,609,130.00	0.53
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	3,944,052.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	439,870,480.67	19.99

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	002142	宁波银行	2,369,710	59,953,663.00	2.72
2	601677	明泰铝业	3,079,315	42,740,892.20	1.94
3	603612	索通发展	1,823,500	31,601,255.00	1.44
4	601233	桐昆股份	2,021,700	26,787,525.00	1.22
5	002884	凌霄泵业	1,116,574	17,027,753.50	0.77
6	600461	洪城环境	2,067,700	16,893,109.00	0.77
7	002100	天康生物	1,952,000	16,104,000.00	0.73
8	601336	新华保险	433,900	15,954,503.00	0.72
9	002801	微光股份	483,936	13,095,308.16	0.60
10	603995	甬金股份	548,533	12,872,603.85	0.58

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	116,911,247.43	5.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	25,187,088.11	1.14
	其中：政策性金融债	25,187,088.11	1.14
4	企业债券	10,233,908.49	0.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,304,107,772.22	104.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,456,440,016.25	111.62

注:可转债项下包含可交换债163,991,268.49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	110053	苏银转债	1,604,850	201,755,586.41	9.17
2	132018	G三峡EB1	1,156,000	163,991,268.49	7.45
3	127049	希望转2	1,395,672	155,270,307.16	7.06
4	113057	中银转债	1,029,730	134,180,815.52	6.10
5	123107	温氏转债	706,160	88,690,890.71	4.03

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，【江苏银行股份有限公司】于2023年02月06日收到中国人民银行出具公开处罚的通报；【宁波银行股份有限公司】分别于2022年09月08日、2023年01月09日收到中国银行保险监督管理委员会宁波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	255,296.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	130,372.70
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	385,669.51

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	110053	苏银转债	201,755,586.41	9.17
2	132018	G三峡EB1	163,991,268.49	7.45
3	127049	希望转2	155,270,307.16	7.06
4	113057	中银转债	134,180,815.52	6.10
5	123107	温氏转债	88,690,890.71	4.03
6	113025	明泰转债	51,676,727.55	2.35
7	127032	苏行转债	49,124,847.23	2.23
8	127020	中金转债	43,048,487.15	1.96

9	127070	大中转债	41,717,692.60	1.90
10	110075	南航转债	41,582,150.60	1.89
11	128140	润建转债	41,390,399.33	1.88
12	113060	浙22转债	35,564,370.46	1.62
13	113050	南银转债	33,288,999.14	1.51
14	110077	洪城转债	31,847,011.92	1.45
15	128128	齐翔转2	30,660,098.63	1.39
16	111010	立昂转债	29,852,812.68	1.36
17	113615	金诚转债	29,221,958.76	1.33
18	111000	起帆转债	28,775,928.81	1.31
19	127039	北港转债	28,696,854.85	1.30
20	113648	巨星转债	26,050,606.45	1.18
21	127075	百川转2	25,855,821.52	1.17
22	113647	禾丰转债	25,118,749.55	1.14
23	127063	贵轮转债	24,934,422.43	1.13
24	127061	美锦转债	24,176,173.15	1.10
25	123169	正海转债	23,340,031.27	1.06
26	123158	宙邦转债	22,429,826.28	1.02
27	123092	天壕转债	22,133,539.66	1.01
28	127006	敖东转债	21,234,842.91	0.96
29	110079	杭银转债	21,047,712.41	0.96
30	127050	麒麟转债	20,221,916.03	0.92
31	123164	法本转债	19,963,744.42	0.91
32	123167	商络转债	19,840,293.14	0.90
33	118015	芯海转债	16,647,782.00	0.76
34	123133	佩蒂转债	15,886,165.63	0.72
35	128074	游族转债	15,806,825.75	0.72
36	123091	长海转债	15,358,746.89	0.70
37	113640	苏利转债	15,333,199.38	0.70
38	110073	国投转债	15,145,165.48	0.69
39	113657	再22转债	14,463,619.64	0.66
40	123124	晶瑞转2	14,247,913.71	0.65
41	123022	长信转债	13,691,369.00	0.62

42	110080	东湖转债	13,053,929.33	0.59
43	113027	华钰转债	12,805,000.82	0.58
44	118003	华兴转债	12,757,006.85	0.58
45	118021	新致转债	12,467,572.78	0.57
46	127077	华宏转债	12,448,507.30	0.57
47	128083	新北转债	11,839,573.97	0.54
48	128109	楚江转债	11,719,144.92	0.53
49	123035	利德转债	11,617,036.75	0.53
50	128087	孚日转债	11,434,681.67	0.52
51	113662	豪能转债	11,406,900.82	0.52
52	128137	洁美转债	11,128,563.77	0.51
53	128133	奇正转债	10,754,036.99	0.49
54	113504	艾华转债	10,181,632.88	0.46
55	113064	东材转债	10,108,124.03	0.46
56	128141	旺能转债	9,854,447.29	0.45
57	113044	大秦转债	9,241,293.15	0.42
58	127018	本钢转债	9,123,835.94	0.41
59	113653	永22转债	8,706,106.30	0.40
60	128131	崇达转2	8,701,641.74	0.40
61	113594	淳中转债	8,632,643.84	0.39
62	118024	冠宇转债	8,515,006.40	0.39
63	113598	法兰转债	7,935,212.33	0.36
64	127019	国城转债	7,914,852.05	0.36
65	110083	苏租转债	7,728,803.84	0.35
66	123059	银信转债	7,714,820.18	0.35
67	127053	豪美转债	7,370,866.85	0.33
68	123152	润禾转债	7,198,423.90	0.33
69	118011	银微转债	6,929,274.13	0.31
70	118006	阿拉转债	6,916,047.18	0.31
71	123130	设研转债	6,584,712.33	0.30
72	113660	寿22转债	6,391,063.67	0.29
73	127034	绿茵转债	6,381,353.42	0.29
74	118012	微芯转债	6,283,324.66	0.29

75	118023	广大转债	6,251,080.82	0.28
76	123120	隆华转债	5,965,613.43	0.27
77	127045	牧原转债	5,818,534.60	0.26
78	127029	中钢转债	5,814,803.01	0.26
79	128044	岭南转债	5,631,208.50	0.26
80	127060	湘佳转债	5,560,200.00	0.25
81	110067	华安转债	5,490,731.51	0.25
82	127054	双箭转债	5,477,468.88	0.25
83	123170	南电转债	5,368,160.00	0.24
84	113043	财通转债	5,341,847.95	0.24
85	113534	鼎胜转债	5,004,607.39	0.23
86	128106	华统转债	4,859,489.73	0.22
87	127069	小熊转债	4,830,095.34	0.22
88	123087	明电转债	4,490,657.58	0.20
89	111005	富春转债	4,483,456.85	0.20
90	110090	爱迪转债	4,410,192.14	0.20
91	113566	翔港转债	4,405,736.74	0.20
92	127074	麦米转2	4,390,624.04	0.20
93	113636	甬金转债	4,339,166.62	0.20
94	110072	广汇转债	4,279,329.15	0.19
95	123157	科蓝转债	4,127,111.77	0.19
96	110063	鹰19转债	4,049,791.20	0.18
97	123143	胜蓝转债	3,803,129.59	0.17
98	128033	迪龙转债	3,799,914.25	0.17
99	111002	特纸转债	3,540,319.55	0.16
100	113663	新化转债	3,495,534.25	0.16
101	123165	回天转债	3,409,872.33	0.15
102	127058	科伦转债	3,401,496.99	0.15
103	128121	宏川转债	3,378,298.59	0.15
104	118018	瑞科转债	3,289,845.54	0.15
105	123050	聚飞转债	3,256,141.64	0.15
106	128105	长集转债	3,054,698.86	0.14
107	110043	无锡转债	2,912,862.83	0.13

108	118013	道通转债	2,863,233.52	0.13
109	113039	嘉泽转债	2,639,706.30	0.12
110	123168	惠云转债	2,576,804.65	0.12
111	128081	海亮转债	2,550,997.26	0.12
112	110062	烽火转债	2,495,273.97	0.11
113	128125	华阳转债	2,220,528.77	0.10
114	128034	江银转债	2,176,509.04	0.10
115	110087	天业转债	2,173,140.27	0.10
116	123113	仙乐转债	2,139,000.00	0.10
117	111007	永和转债	2,109,427.75	0.10
118	123076	强力转债	2,074,011.76	0.09
119	118017	深科转债	2,052,458.86	0.09
120	113602	景20转债	2,032,346.30	0.09
121	110081	闻泰转债	2,011,106.96	0.09
122	123099	普利转债	1,889,054.21	0.09
123	110048	福能转债	1,797,827.12	0.08
124	113519	长久转债	1,647,678.34	0.07
125	123127	耐普转债	1,603,796.55	0.07
126	123078	飞凯转债	1,505,435.62	0.07
127	123085	万顺转2	1,470,028.77	0.07
128	127047	帝欧转债	1,329,092.35	0.06
129	113593	沪工转债	1,308,716.42	0.06
130	113651	松霖转债	1,181,070.67	0.05
131	128036	金农转债	1,100,027.75	0.05
132	113609	永安转债	1,080,630.00	0.05
133	123131	奥飞转债	927,515.34	0.04

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603995	甬金股份	6,924,871.80	0.31	非公开发行限售

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

	天弘弘丰增强回报A	天弘弘丰增强回报C
报告期期初基金份额总额	892,874,300.38	577,146,974.73
报告期期间基金总申购份额	451,561,027.88	238,847,902.81
减：报告期期间基金总赎回份额	165,447,865.87	90,705,407.43
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	1,178,987,462.39	725,289,470.11

§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弘丰增强回报债券型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金基金合同
- 3、天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金托管协议
- 4、天弘弘丰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
二〇二三年七月二十一日