

天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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

送出日期:2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2021年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 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	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 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贵金属投资明细	49
7.9 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	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§9 开放式基金份额变动	54
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
11.1 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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	219,657,487.21份	
基金合同存续期	不定期	
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额	193,801,769.61份	25,855,717.60份

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	童建林	陆志俊
	联系电话	022-83310208	95559

人	电子邮箱	service@thfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95046	95559
传真		022-83865569	021-62701216
注册地址	天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号	
办公地址	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	中国（上海）长宁区仙霞路18号	
邮政编码		300203	200336
法定代表人	胡晓明	任德奇	

注：在本报告截止日至报告批准送出日之间，法定住所变更为：天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层；法定代表人变更为：韩歆毅。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)
---------------	----------------------------------

	天弘弘丰增强回报A	天弘弘丰增强回报C
本期已实现收益	6,164,010.69	423,869.75
本期利润	18,736,472.02	-846,391.08
加权平均基金份额本期利润	0.1022	-0.0385
本期加权平均净值利润率	9.78%	-3.72%
本期基金份额净值增长率	9.99%	9.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	18,026,146.86	2,152,694.67
期末可供分配基金份额利润	0.0930	0.0833
期末基金资产净值	215,891,633.12	28,542,849.21
期末基金份额净值	1.1140	1.1039
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	11.40%	10.39%

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	0.52%	0.51%	-0.43%	0.17%	0.95%	0.34%
过去三个月	7.74%	0.43%	1.09%	0.20%	6.65%	0.23%
过去六个月	9.99%	0.59%	0.73%	0.27%	9.26%	0.32%
过去一年	6.85%	0.53%	4.84%	0.26%	2.01%	0.27%
自基金合 同生效日 起至今	11.40%	0.35%	8.57%	0.25%	2.83%	0.10%

天弘弘丰增强回报C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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
过去一个月	0.48%	0.51%	-0.43%	0.17%	0.91%	0.34%
过去三个月	7.62%	0.44%	1.09%	0.20%	6.53%	0.24%
过去六个月	9.78%	0.59%	0.73%	0.27%	9.05%	0.32%
过去一年	6.43%	0.53%	4.84%	0.26%	1.59%	0.27%
自基金合 同生效日 起至今	10.39%	0.35%	8.57%	0.25%	1.82%	0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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-2021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-2021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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立。注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、天津、深圳、四川设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2021年6月30日，本基金管理人共管理117只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘文化新兴产业股票型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康颐养混合型证券投资基金、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金（LOF）、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘医疗健康混合型证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数增强型证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘中证食品饮料指数

型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘优选债券型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘悦享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金、天弘港股通精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘增强回报债券型证券投资基金、天弘安益债券型证券投资基金、天弘华享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘弘择短债债券型证券投资基金、天弘信益债券型证券投资基金、天弘养老目标日期2035三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘弘新混合型发起式证券投资基金、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金、天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）、天弘优质成长企业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘鑫利三年定期开放债券型证券投资基金、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金、天弘季季兴三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金、天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金、天弘越南市场股票型发起式证券投资基金（QDII）、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘增利短债债券型发起式证券投资基金、天弘恒享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘纯享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中债1-3年国开行债券指数发起式证券投资基金、天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、天弘鑫意39个月定期开放债券型证券投资基金、天弘兴享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中证中美互联网指数型发起式证券投资基金（QDII）、天弘中债3-5年政策性金融债指数发起式证券投资基金、天弘成享一年定期开放债券型证券投资基金、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金、天弘永裕平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘甄选食品饮料股票型发起式证券投资基金、天弘创新领航混合型证券投资基金、天弘聚新三个月定期开放混合型证券投资基金、天弘荣创一年持有期混合型证券投资基金、天弘智荟6个月持有期债券型证券投资基金、天弘中证科技100指数增强型发起式证券投资基金、天弘多元收益债券型证券投资基金、天弘多利一年定期开放混合型证券投资基金、天弘安利短债债券型证券投资基金、天弘安康颐和混合型证券投资基金、天弘合益债券型发起式证券投资基金、天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金、天弘国证消费100指数增强型发起式证券投资基金、天弘医药创新混合型证券投资基金、天弘睿新三个月定期开放混合型证券投资基金、天弘庆享债券型发起式证券投资基金、天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金、天弘中证农业主题指数型发起式证券投资基金、天弘国证生物医药指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证光伏产

业交易型开放式指数证券投资基金、天弘创新成长混合型发起式证券投资基金、天弘国证A50指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、天弘益新混合型证券投资基金、天弘招添利混合型发起式证券投资基金、天弘消费股票型发起式证券投资基金、天弘中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金、天弘中债1-5年政策性金融债指数发起式证券投资基金、天弘先进制造混合型证券投资基金、天弘创业板300指数型发起式证券投资基金、天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金、天弘安怡30天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、天弘安盈一年持有期债券型发起式证券投资基金、天弘京津冀主题债券型发起式证券投资基金、天弘中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘兴益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金、天弘国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证全指医疗保健设备与服务指数型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜广	基金经理	2020年07月	-	7年	男，金融数学硕士。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、基金经理助理。
王昌俊	基金经理	2020年05月	2021年05月	14年	男，数学硕士。历任安信证券股份有限公司固定收益分析师、光大永明人寿保险有限公司高级投资经理、光大永明资产管理股份有限公司投资管理总部董事总经理、先锋基金管

					理有限公司固定收益总监。2017年7月加盟本公司。
赵鼎龙	基金经理助理	2019年03月	-	6年	男，电子学硕士。历任泰康资产管理有限责任公司固收交易员。2017年8月加盟本公司，历任固定收益机构投资部研究员、投资经理助理、基金经理助理。

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、本基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作，不具有独立决策职能。

3、在本报告截止日至报告批准送出日之间，本基金管理人增聘徐凯先生为本基金基金经理助理。

4、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。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。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，未产生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，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

我们坚持的投资理念是以中低价转债为客户长期获取好的绝对收益，侧重于对成长类、正股波动率较高、相对低价的转债投资，以期望去以尽可能高地概率兑现转债蕴含的期权价值。

市场在一月份经历了比较大幅的杀跌，我们在年报中也阐述过背后的逻辑，到了2月初，中低价转债已经到了历史最低的估值水平，随后开启了一轮比较大的修复行情。除了估值修复的驱动，还有其他因素在发挥作用：转债下修频繁发生，信用担忧情绪在缓解，同时市场对中小盘低估值的优秀个股的关注度在不断提升。

因此整个上半年整体保持了比较高的转债仓位，伴随着市场的上涨，取得了一定的正收益。

股票方面依然坚持绝对收益思路，在大金融、消费、公用事业、周期成长股中，综合公司质地、增速、估值等层面，寻找收益相对确定的标的，不追求短期业绩排名，追求长期实现可观、稳定的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年06月30日，天弘弘丰增强回报A基金份额净值为1.1140元，天弘弘丰增强回报C基金份额净值为1.1039元。报告期内份额净值增长率天弘弘丰增强回报A为9.99%，同期业绩比较基准增长率为0.73%；天弘弘丰增强回报C为9.78%，同期业绩比较基准增长率为0.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票市场风格对我们的转债持仓风格依然比较有利，资金从茅指数开始向外扩散，从披露的年报和一季报数据来看，大盘对小盘的相对业绩进一步下滑，中小盘股的盈利

驱动力较强，正股估值相对合理，转债性价比处于较优区间。转债方面，低价转债的估值已经得到显著修复，我们观测的利差指标修复到接近0的水平，债性转债溢价率也修复到历史中位数附近。仓位方面，之前的转债仓位比较高，后续要陆续兑现利润，及时调整组合结构。

股票方面依然坚持绝对收益思路，在大金融、消费、公用事业、周期成长股中，综合公司质地、增速、估值等层面，寻找收益相对确定的标的，不追求短期业绩排名，追求长期实现可观、稳定的绝对收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、基金会计、风险管理人员及内控合规人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，天弘基金管理有限公司在天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由天弘基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,549,592.22	3,798,081.27
结算备付金		4,483,819.34	5,525,498.31
存出保证金		35,283.45	31,741.19
交易性金融资产	6.4.7.2	304,436,529.46	261,881,361.79
其中：股票投资		24,496,674.80	—
基金投资		—	—
债券投资		279,939,854.66	261,881,361.79
资产支持证券投资		—	—

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		124,751.79	-
应收利息	6.4.7.5	931,352.78	1,137,481.96
应收股利		-	-
应收申购款		466,851.16	161,811.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		314,028,180.20	272,535,976.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		65,000,000.00	69,100,000.00
应付证券清算款		2,056,074.38	1,973,535.67
应付赎回款		2,196,684.02	53,929.51
应付管理人报酬		144,556.30	110,955.28
应付托管费		41,301.83	31,701.50
应付销售服务费		11,229.79	8,114.95
应付交易费用	6.4.7.7	45,296.57	-
应交税费		7,355.23	4,132.91
应付利息		-	-21,653.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	91,199.75	189,359.20
负债合计		69,593,697.87	71,450,075.27
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	219,657,487.21	198,713,097.54

未分配利润	6.4.7.10	24,776,995.12	2,372,803.38
所有者权益合计		244,434,482.33	201,085,900.92
负债和所有者权益总计		314,028,180.20	272,535,976.19

注：报告截止日2021年06月30日，天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金A类基金份额净值1.1140元，天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金C类基金份额净值1.1039元；基金份额总额219,657,487.21份，其中天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金A类基金份额193,801,769.61份，天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金C类基金份额25,855,717.60份。

6.2 利润表

会计主体：天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		19,848,850.19	3,331,002.27
1. 利息收入		1,348,899.42	2,502,204.33
其中：存款利息收入	6.4.7.11	43,002.12	33,567.77
债券利息收入		1,305,897.30	2,456,050.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	12,586.46
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,120,818.94	826,808.59
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-267,940.37	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,042,183.21	826,808.59

资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	346,576.10	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,302,200.50	-28,844.67
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	76,931.33	30,834.02
减：二、费用		1,958,769.25	795,686.44
1. 管理人报酬		738,062.59	437,881.03
2. 托管费		210,875.02	125,108.92
3. 销售服务费		43,118.42	17,083.50
4. 交易费用	6.4.7.19	86,069.84	4,413.19
5. 利息支出		775,397.50	88,087.94
其中：卖出回购金融资产 支出		775,397.50	88,087.94
6. 税金及附加		2,814.57	7,484.68
7. 其他费用	6.4.7.20	102,431.31	115,627.18
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		17,890,080.94	2,535,315.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		17,890,080.94	2,535,315.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期
-----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	198,713,097.54	2,372,803.38	201,085,900.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,890,080.94	17,890,080.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	20,944,389.67	4,514,110.80	25,458,500.47
其中: 1. 基金申购款	113,308,605.63	6,063,569.88	119,372,175.51
2. 基金赎回款	-92,364,215.96	-1,549,459.08	-93,913,675.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	219,657,487.21	24,776,995.12	244,434,482.33
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	208,988,957.10	8,046,123.28	217,035,080.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,535,315.83	2,535,315.83
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-160,842,732.52	-8,564,682.81	-169,407,415.33

其中：1. 基金申购款	22,108,496.36	1,178,888.47	23,287,384.83
2. 基金赎回款	-182,951,228.88	-9,743,571.28	-192,694,800.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	48,146,224.58	2,016,756.30	50,162,980.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]2029号《关于准予天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金注册的批复》注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币527,484,392.52元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0167号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金基金合同》于2019年03月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为527,718,627.71份基金份额,其中认购资金利息折合234,235.19份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金基金合同》和《天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,而从本类别基金资产中计提销售服务费

的，称为C类基金份额。基金A类和C类基金份额分别设置代码两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额及C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含可分离型可转换债券）、可交换债券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股票（包括创业板、中小板以及其他依法发行上市的股票）、权证、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于债券资产不低于基金资产的80%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；投资于权益类资产（包括股票、权证，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他权益类金融工具）不高于基金资产的20%，其中，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率 $\times$ 80%+沪深300指数收益率 $\times$ 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2021年06月30日的财务状况以及2021年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	3,549,592.22
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
合计	3,549,592.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		25,780,867.43	24,496,674.80	-1,284,192.63
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	275,454,282.86	278,943,154.66	3,488,871.80
	银行间市场	994,620.00	996,700.00	2,080.00
	合计	276,448,902.86	279,939,854.66	3,490,951.80
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		302,229,770.29	304,436,529.46	2,206,759.17

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	393.23
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	2,017.70
应收债券利息	928,925.95
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	15.90
合计	931,352.78

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
----	--------------------

交易所市场应付交易费用	45,144.07
银行间市场应付交易费用	152.50
合计	45,296.57

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,558.40
应付证券出借违约金	-
预提费用	88,641.35
合计	91,199.75

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 天弘弘丰增强回报A

金额单位：人民币元

项目 (天弘弘丰增强回报A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	174,585,705.49	174,585,705.49
本期申购	42,560,775.05	42,560,775.05
本期赎回（以“-”号填列）	-23,344,710.93	-23,344,710.93
本期末	193,801,769.61	193,801,769.61

6.4.7.9.2 天弘弘丰增强回报C

金额单位：人民币元

项目 (天弘弘丰增强回报C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,127,392.05	24,127,392.05
本期申购	70,747,830.58	70,747,830.58

本期赎回（以“-”号填列）	-69,019,505.03	-69,019,505.03
本期末	25,855,717.60	25,855,717.60

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 天弘弘丰增强回报A

单位：人民币元

项目 (天弘弘丰增强回报A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,883,292.64	-8,645,358.27	2,237,934.37
本期利润	6,164,010.69	12,572,461.33	18,736,472.02
本期基金份额交易产生的变动数	978,843.53	136,613.59	1,115,457.12
其中：基金申购款	2,471,770.21	219,877.29	2,691,647.50
基金赎回款	-1,492,926.68	-83,263.70	-1,576,190.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,026,146.86	4,063,716.65	22,089,863.51

6.4.7.10.2 天弘弘丰增强回报C

单位：人民币元

项目 (天弘弘丰增强回报C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,322,879.06	-1,188,010.05	134,869.01
本期利润	423,869.75	-1,270,260.83	-846,391.08
本期基金份额交易产生的变动数	405,945.86	2,992,707.82	3,398,653.68
其中：基金申购款	3,782,620.94	-410,698.56	3,371,922.38
基金赎回款	-3,376,675.08	3,403,406.38	26,731.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,152,694.67	534,436.94	2,687,131.61

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	7,458.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	35,272.85
其他	270.94
合计	43,002.12

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	17,841,484.77
减：卖出股票成本总额	18,109,425.14
买卖股票差价收入	-267,940.37

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	7,042,183.21
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	7,042,183.21

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	418,118,646.51
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	409,986,167.07
减：应收利息总额	1,090,296.23
买卖债券差价收入	7,042,183.21

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	346,576.10
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	346,576.10

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	11,302,200.50
——股票投资	-1,284,192.63
——债券投资	12,586,393.13
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	11,302,200.50

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	76,265.34
基金转换费收入	665.99
合计	76,931.33

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	85,917.34
银行间市场交易费用	152.50
合计	86,069.84

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	49,588.57
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,789.96
银行间账户维护费	18,300.00
合计	102,431.31

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	738,062.59	437,881.03
其中：支付销售机构的客户维护费	82,485.76	267,653.35

注：1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	210,875.02	125,108.92

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售	本期
------	----

服务费的各关联方名称	2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘弘丰增强回报A	天弘弘丰增强回报C	合计
天弘基金管理有限公司	-	15,858.94	15,858.94
交通银行股份有限公司	-	999.06	999.06
合计	-	16,858.00	16,858.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘弘丰增强回报A	天弘弘丰增强回报C	合计
天弘基金管理有限公司	-	5,311.61	5,311.61
交通银行股份有限公司	-	979.20	979.20
合计	-	6,290.81	6,290.81

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。天弘弘丰增强回报C按0.40%计提销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日各级基金资产净值 × 该日适用费率 / 当年天数。

2、天弘弘丰增强回报A不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	3,549,592.22	7,458.33	620,102.93	12,705.65

注：本基金由基金托管人交通银行股份有限公司保管的银行存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末及上年度末无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年06月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额65,000,000.00元，于2021年07月01日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括固定收益类产品。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取在严格控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施

等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人交通银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2021年06月30日	2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	2,703,671.60	3,092,949.60
合计	2,703,671.60	3,092,949.60

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	81,844,379.12	82,225,739.52
AAA以下	185,190,696.71	162,260,564.67
未评级	10,201,107.23	14,302,108.00
合计	277,236,183.06	258,788,412.19

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方

面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2021年06月30日，除卖出回购金融资产款余额中有65,000,000.00元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,549,592.22	-	-	-	3,549,592.22
结算备付金	4,483,819.34	-	-	-	4,483,819.34
存出保证金	35,283.45	-	-	-	35,283.45
交易性金融资产	21,081,878.83	141,765,447.09	117,092,528.74	24,496,674.80	304,436,529.46
应收证券清算款	-	-	-	124,751.79	124,751.79
应收利息	-	-	-	931,352.78	931,352.78
应收申购款	-	-	-	466,851.16	466,851.16
资产总计	29,150,573.	141,765,44	117,092,52	26,019,63	314,028,18

	84	7.09	8.74	0.53	0.20
负债					
卖出回购金融资产款	65,000,000.00	-	-	-	65,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	2,056,074.38	2,056,074.38
应付赎回款	-	-	-	2,196,684.02	2,196,684.02
应付管理人报酬	-	-	-	144,556.30	144,556.30
应付托管费	-	-	-	41,301.83	41,301.83
应付销售服务费	-	-	-	11,229.79	11,229.79
应付交易费用	-	-	-	45,296.57	45,296.57
应交税费	-	-	-	7,355.23	7,355.23
其他负债	-	-	-	91,199.75	91,199.75
负债总计	65,000,000.00	-	-	4,593,697.87	69,593,697.87
利率敏感度缺口	-35,849,426.16	141,765,447.09	117,092,528.74	21,425,932.66	244,434,482.33
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,798,081.27	-	-	-	3,798,081.27
结算备付金	5,525,498.31	-	-	-	5,525,498.31
存出保证金	31,741.19	-	-	-	31,741.19
交易性金融资产	12,246,077.60	147,687,393.31	101,947,890.88	-	261,881,361.79
应收利息	-	-	-	1,137,481.96	1,137,481.96
应收申购款	-	-	-	161,811.67	161,811.67
资产总计	21,601,398.37	147,687,393.31	101,947,890.88	1,299,293.63	272,535,976.19
负债					
卖出回购金融资产款	69,100,000.00	-	-	-	69,100,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1,973,535.67	1,973,535.67
应付赎回款	-	-	-	53,929.51	53,929.51
应付管理人报酬	-	-	-	110,955.28	110,955.28
应付托管费	-	-	-	31,701.50	31,701.50
应付销售服务费	-	-	-	8,114.95	8,114.95
应交税费	-	-	-	4,132.91	4,132.91

应付利息	-	-	-	-21,653.75	-21,653.75
其他负债	-	-	-	189,359.20	189,359.20
负债总计	69,100,000.00	-	-	2,350,075.27	71,450,075.27
利率敏感度缺口	-47,498,601.63	147,687,393.31	101,947,890.88	-1,050,781.64	201,085,900.92

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率下降25个基点	2,737,903.00	2,835,568.84
	市场利率上升25个基点	-2,700,764.23	-2,784,782.09

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券资产不低于基金资产的80%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；投资于权益类资产(包括股票、权证，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他权益类

金融工具)不高于基金资产的20%，其中，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	24,496,674.80	10.02	—	—
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	24,496,674.80	10.02	—	—

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2021年06月30日，本基金持有的交易性权益类投资占基金资产净值的比例为10.02%(2020年12月31日：本基金未持有交易性权益类投资)，因此其他价格风险对于本基金资产净值无重大影响(2020年12月31日：同)。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为274,433,250.63元，属于第二层次的余额为30,003,278.83元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次230,135,007.39元，第二层次31,746,354.40元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
----	----	----	--------------

1	权益投资	24,496,674.80	7.80
	其中：股票	24,496,674.80	7.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	279,939,854.66	89.14
	其中：债券	279,939,854.66	89.14
	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	8,033,411.56	2.56
8	其他各项资产	1,558,239.18	0.50
9	合计	314,028,180.20	100.00

7.2 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	633,293.00	0.26
C	制造业	6,663,973.80	2.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	478,578.00	0.20
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	857,900.00	0.35
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	11,852,408.00	4.85
K	房地产业	830,760.00	0.34
L	租赁和商务服务业	1,318,896.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	1,860,866.00	0.76
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	24,496,674.80	10.02

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	601166	兴业银行	119,800	2,461,890.00	1.01
2	601601	XD中国太	84,800	2,456,656.00	1.01
3	601658	邮储银行	428,600	2,151,572.00	0.88
4	600323	瀚蓝环境	85,400	1,860,866.00	0.76
5	600346	恒力石化	51,800	1,359,232.00	0.56
6	605168	三人行	8,600	1,318,896.00	0.54
7	002798	帝欧家居	75,900	1,182,522.00	0.48
8	002064	华峰化学	79,400	1,127,480.00	0.46
9	600690	海尔智家	42,400	1,098,584.00	0.45
10	000001	平安银行	47,500	1,074,450.00	0.44
11	601939	建设银行	157,900	1,050,035.00	0.43
12	600048	保利地产	69,000	830,760.00	0.34
13	601288	农业银行	267,100	809,313.00	0.33
14	603008	喜临门	22,500	742,725.00	0.30
15	002430	杭氧股份	18,800	650,292.00	0.27
16	601398	工商银行	125,300	647,801.00	0.27
17	601225	陕西煤业	42,900	508,365.00	0.21
18	000776	广发证券	31,700	479,938.00	0.20
19	600886	国投电力	49,800	478,578.00	0.20

20	601688	华泰证券	30,000	474,000.00	0.19
21	001965	招商公路	65,500	472,910.00	0.19
22	600350	山东高速	62,600	384,990.00	0.16
23	603801	志邦家居	8,640	276,134.40	0.11
24	600958	东方证券	24,700	246,753.00	0.10
25	603180	金牌厨柜	4,760	227,004.40	0.09
26	601088	中国神华	6,400	124,928.00	0.05

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	5,077,653.11	2.53
2	601166	兴业银行	4,189,044.00	2.08
3	601601	中国太保	3,543,445.00	1.76
4	601658	邮储银行	2,350,756.00	1.17
5	600000	浦发银行	2,206,610.00	1.10
6	600323	瀚蓝环境	1,997,457.43	0.99
7	601288	农业银行	1,741,492.00	0.87
8	002798	帝欧家居	1,265,630.22	0.63
9	600690	海尔智家	1,261,607.00	0.63
10	601012	隆基股份	1,256,220.00	0.62
11	600438	通威股份	1,253,848.00	0.62
12	002430	杭氧股份	1,252,754.00	0.62
13	600346	恒力石化	1,234,715.00	0.61
14	605168	三人行	1,225,986.00	0.61
15	601939	建设银行	1,095,083.00	0.54
16	601398	工商银行	1,094,112.00	0.54
17	000001	平安银行	1,092,140.00	0.54
18	002064	华峰化学	1,041,357.00	0.52

19	002466	天齐锂业	999,162.60	0.50
20	600886	国投电力	982,478.00	0.49

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	4,982,095.00	2.48
2	600000	浦发银行	2,187,430.00	1.09
3	601166	兴业银行	1,399,918.00	0.70
4	601012	隆基股份	1,366,935.00	0.68
5	600438	通威股份	1,157,727.77	0.58
6	002466	天齐锂业	1,055,594.00	0.52
7	601288	农业银行	817,326.00	0.41
8	601601	中国太保	655,073.00	0.33
9	603587	地素时尚	629,479.00	0.31
10	002430	杭氧股份	615,946.00	0.31
11	002555	三七互娱	588,643.00	0.29
12	002624	完美世界	554,763.00	0.28
13	600886	国投电力	494,514.00	0.25
14	601818	光大银行	436,620.00	0.22
15	601398	工商银行	434,200.00	0.22
16	600958	东方证券	253,422.00	0.13
17	603801	志邦家居	211,799.00	0.11

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	43,890,292.57
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	17,841,484.77
--------------	---------------

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	6,912,071.60	2.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,992,707.23	2.45
	其中：政策性金融债	5,992,707.23	2.45
4	企业债券	17,098,500.00	7.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	249,936,575.83	102.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	279,939,854.66	114.53

注：可转债项下包含可交换债2,976,350.00元。

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	206,160	23,827,972.80	9.75
2	110072	广汇转债	196,310	18,007,516.30	7.37
3	127018	本钢转债	145,430	14,554,634.40	5.95
4	110053	苏银转债	112,000	13,592,320.00	5.56
5	149161	20穗控03	100,000	10,076,000.00	4.12

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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2020年12月30日收到中国银行保险监督管理委员会江苏监管局出具公开处罚的通报。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	35,283.45
2	应收证券清算款	124,751.79
3	应收股利	-
4	应收利息	931,352.78
5	应收申购款	466,851.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,558,239.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113011	光大转债	23,827,972.80	9.75
2	110072	广汇转债	18,007,516.30	7.37
3	127018	本钢转债	14,554,634.40	5.95
4	110053	苏银转债	13,592,320.00	5.56
5	113599	嘉友转债	8,102,140.20	3.31
6	113528	长城转债	7,283,110.20	2.98
7	128138	侨银转债	6,601,820.00	2.70
8	123053	宝通转债	6,003,531.30	2.46
9	113519	长久转债	5,934,483.20	2.43
10	113530	大丰转债	5,304,364.80	2.17
11	113598	法兰转债	4,974,807.90	2.04
12	123044	红相转债	4,416,864.66	1.81
13	123049	维尔转债	4,352,366.72	1.78
14	113525	台华转债	4,127,780.40	1.69
15	128042	凯中转债	4,100,006.00	1.68
16	127013	创维转债	3,353,265.00	1.37
17	123050	聚飞转债	3,246,320.00	1.33
18	113608	威派转债	2,900,718.60	1.19
19	123084	高澜转债	2,726,018.28	1.12
20	123087	明电转债	2,675,813.40	1.09
21	128049	华源转债	2,621,693.75	1.07
22	113594	XD淳中转	2,564,366.70	1.05
23	110047	山鹰转债	2,527,072.20	1.03
24	128056	今飞转债	2,493,495.40	1.02
25	128018	时达转债	2,476,621.00	1.01
26	110048	福能转债	2,468,558.40	1.01
27	123056	雪榕转债	2,371,258.56	0.97
28	113524	奇精转债	2,356,009.30	0.96
29	123075	贝斯转债	2,169,800.00	0.89

30	123057	美联转债	2,152,345.20	0.88
31	113615	金诚转债	2,126,329.60	0.87
32	127025	冀东转债	2,083,347.72	0.85
33	123059	银信转债	2,067,769.50	0.85
34	128119	龙大转债	2,041,700.00	0.84
35	110068	龙净转债	2,012,800.00	0.82
36	128023	亚太转债	1,915,911.90	0.78
37	113600	新星转债	1,779,031.10	0.73
38	127019	国城转债	1,679,888.32	0.69
39	128125	华阳转债	1,552,450.00	0.64
40	113593	沪工转债	1,518,248.00	0.62
41	123010	博世转债	1,501,884.30	0.61
42	113573	纵横转债	1,488,140.00	0.61
43	110075	南航转债	1,474,680.00	0.60
44	123086	海兰转债	1,439,624.40	0.59
45	127026	超声转债	1,399,450.00	0.57
46	113535	大业转债	1,382,690.00	0.57
47	113566	翔港转债	1,363,843.40	0.56
48	113610	灵康转债	1,341,902.80	0.55
49	113546	迪贝转债	1,235,614.60	0.51
50	123023	迪森转债	1,216,095.50	0.50
51	110033	国贸转债	1,154,600.00	0.47
52	128039	三力转债	1,058,100.00	0.43
53	123085	万顺转2	1,032,920.72	0.42
54	127015	希望转债	1,026,361.20	0.42
55	113578	全筑转债	1,009,100.00	0.41
56	123076	强力转债	1,008,296.52	0.41
57	123088	威唐转债	929,889.66	0.38
58	127027	靖远转债	899,459.64	0.37
59	128107	交科转债	867,611.52	0.35
60	113542	好客转债	814,200.00	0.33

61	128106	华统转债	678,852.30	0.28
62	128121	宏川转债	648,287.64	0.27
63	128066	亚泰转债	619,800.00	0.25
64	128133	奇正转债	615,720.00	0.25
65	127022	恒逸转债	614,000.00	0.25
66	128114	正邦转债	609,984.96	0.25
67	128063	未来转债	528,550.00	0.22
68	132022	20广版EB	501,350.00	0.21
69	123081	精研转债	453,963.60	0.19
70	128069	华森转债	422,320.00	0.17
71	113604	多伦转债	368,375.00	0.15
72	123039	开润转债	318,390.00	0.13
73	113601	塞力转债	304,410.00	0.12
74	113588	润达转债	263,154.00	0.11
75	123077	汉得转债	256,050.00	0.10
76	110043	无锡转债	225,360.00	0.09
77	128094	星帅转债	215,092.71	0.09
78	123051	今天转债	132,205.80	0.05
79	113567	君禾转债	89,507.20	0.04
80	123065	宝莱转债	80,947.50	0.03
81	110059	浦发转债	1,024.30	0.00
82	128044	岭南转债	95.64	0.00

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
天弘弘丰增强回报A	3,397	57,050.86	158,161,308.29	81.61%	35,640,461.32	18.39%
天弘弘丰增强回报C	2,098	12,323.98	4,684,291.03	18.12%	21,171,426.57	81.88%
合计	5,495	39,974.07	162,845,599.32	74.14%	56,811,887.89	25.86%

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天弘弘丰增强回报A	463,241.65	0.24%
	天弘弘丰增强回报C	106,525.11	0.41%
	合计	569,766.76	0.26%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资	天弘弘丰增强回报	0

和研究部门负责人持有本开放式基金	A	
	天弘弘丰增强回报C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘弘丰增强回报A	0~10
	天弘弘丰增强回报C	0~10
	合计	0~10

§ 9 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
基金合同生效日(2019年03月20日)基金份额总额	523,209,599.32	4,509,028.39
本报告期期初基金份额总额	174,585,705.49	24,127,392.05
本报告期基金总申购份额	42,560,775.05	70,747,830.58
减：本报告期基金总赎回份额	23,344,710.93	69,019,505.03
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	193,801,769.61	25,855,717.60

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经天弘基金管理有限公司股东会2021年第2次会议审议通过，胡晓明先生、屠剑威先生、黄浩先生和卢信群先生不再担任公司董事。韩歆毅先生、周志峰先生、祖国明先生和张杰先生担任公司董事。

本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	61,731,777.34	100.00%	45,144.07	100.00%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	829,940,298.93	100.00%	4,481,697,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于终止深圳盈信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-01-01
2	天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
3	关于注意防范冒用天弘创新相关名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-02-24
4	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-03-04
5	天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
6	天弘创新资产管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-04-07
7	天弘弘丰增强回报债券型证	中国证监会指定媒介	2021-04-22

	券投资基金2021年第一季度报告		
8	天弘基金管理有限公司关于调整天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定媒介	2021-05-27
9	天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2021-05-28
10	天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定媒介	2021-05-28
11	天弘基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-02
12	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-02
13	天弘基金管理有限公司关于增加中信建投期货有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-07

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		间					
机 构	1	20210101- 20210630	69,774,22 8.89	-	-	69,774,22 8.89	31.77%
	2	20210101- 20210630	47,177,65 1.24	-	-	47,177,65 1.24	21.48%
产品特有风险							
基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 时，由此可能导致的特有风险主要包括： （1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险； （2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险； （3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险； （4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权； （5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

在本报告截止日至报告批准送出日之间，根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》及相关配套规则、基金合同等法律文件的规定，本基金已于 7 月 27 日相应修订基金合同等法律文件，具体信息请参见基金管理人 7 月 27 日在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同等法律文件的公告》及更新的法律文件。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

12.3 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
二〇二一年八月三十一日