

# 天弘增强回报债券型证券投资基金

## 2021年第4季度报告

2021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:2022年01月24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2021年10月01日起至2021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     | 14,599,444,279.02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 | 7,078,589,98   | 5,739,577,70 | 1,781,276,58 |

|   |       |       |       |
|---|-------|-------|-------|
| 额 | 4.42份 | 7.95份 | 6.65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(2021年10月01日 - 2021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      | 80,064,830.09                  | 55,175,355.25    | 15,337,058.07    |
| 2. 本期利润         | 228,820,125.75                 | 162,927,169.46   | 45,403,168.13    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0444                         | 0.0456           | 0.0396           |
| 4. 期末基金资产净值     | 9,860,180,740.35               | 7,912,796,057.56 | 2,214,514,226.22 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.3930                         | 1.3786           | 1.2432           |

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    | 3.09%  | 0.17%     | 0.82%      | 0.16%         | 2.27%  | 0.01% |
| 过去六个月    | 7.03%  | 0.32%     | 0.13%      | 0.21%         | 6.90%  | 0.11% |
| 过去一年     | 14.30% | 0.37%     | 0.87%      | 0.24%         | 13.43% | 0.13% |
| 自基金合同生效日 | 39.30% | 0.33%     | 9.96%      | 0.24%         | 29.34% | 0.09% |

|     |  |  |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|--|--|
| 起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|--|--|

## 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       | 2.98%  | 0.18%     | 0.82%      | 0.16%         | 2.16%  | 0.02% |
| 过去六个月       | 6.81%  | 0.32%     | 0.13%      | 0.21%         | 6.68%  | 0.11% |
| 过去一年        | 13.84% | 0.37%     | 0.87%      | 0.24%         | 12.97% | 0.13% |
| 自基金合同生效日起至今 | 37.86% | 0.33%     | 9.96%      | 0.24%         | 27.90% | 0.09% |

## 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         | 3.01%  | 0.18%     | 0.82%      | 0.16%         | 2.19%  | 0.02% |
| 过去六个月         | 6.87%  | 0.32%     | 0.13%      | 0.21%         | 6.74%  | 0.11% |
| 过去一年          | 13.96% | 0.37%     | 0.87%      | 0.24%         | 13.09% | 0.13% |
| 自基金份额首次确认日起至今 | 24.32% | 0.38%     | 5.62%      | 0.24%         | 18.70% | 0.14% |

### 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-2021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-2021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    | -    | 4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     | -    | 11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 | - | 12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10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

在三季度末的运作分析中提出，“我们认为宏观的变数比较大，但时间上不确定，货币、财政政策对金融市场的影响将更为直接”。四季度伊始，宏观经济指标还没有出现显著的恶化，但已经看到各类宏观政策开始执行跨周期调节，例如通过行政纠偏手段抑制了上游供给问题，以防范通胀预期的风险，又例如在11月降准提前准备托底，由于地产周期下行预期带来的经济整体下行的风险。

在四季度，我们确实也看到了“货币、财政政策对金融市场的影响将更为直接”。在11月，我们看到货币政策周期偏松，年内第二次全面降准，导致银行体系剩余流动性迅速增加，银行、理财子大量申购各类债券型基金，大量资金涌入债券市场快速压缩了期限利差、信用利差，导致整个债券市场的估值达到历史最贵的区间，这一资金流行为属于剩余流动性驱动的行为，带有极强的被动配置成分。在三季度末运作分析中我们已经提到四季度债券市场会进入剩余流动性驱动的周期，在四季度我们也看到市场出现了极致的估值和仓位水平。

操作上，我们在四季度中通过持有长久期利率债抓住了利率趋势下行，在四季度末之前完成了组合调仓操作，目前以哑铃型组合构建了中性久期，组合流动性较高。

未来，债券市场的剩余流动性驱动行情可能还将持续一段时间，胜率较高，交易赔率较低的状态还将保持一段时间，我们重点关注到目前债券市场杠杆率较高、长久期利率交易拥挤程度较高，未来一段时间需要防范债券市场内生性的负反馈行为。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2021年12月31日，天弘增强回报A基金份额净值为1.3930元，天弘增强回报C基金份额净值为1.3786元，天弘增强回报E基金份额净值为1.2432元。报告期内份额净值增长率天弘增强回报A为3.09%，同期业绩比较基准增长率为0.82%；天弘增强回报C为2.98%，同期业绩比较基准增长率为0.82%；天弘增强回报E为3.01%，同期业绩比较基准增长率为0.82%。

#### 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              | 3,082,946,178.77  | 15.04  |
|   | 其中：股票             | 3,082,946,178.77  | 15.04  |
| 2 | 基金投资              | -                 | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 16,797,115,143.38 | 81.97  |
|   | 其中：债券             | 16,797,115,143.38 | 81.97  |
|   | 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      | 363,716,634.02    | 1.77   |
| 8 | 其他资产              | 248,829,521.45    | 1.21   |
| 9 | 合计                | 20,492,607,477.62 | 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         | 35,881,560.00    | 0.18          |
| B  | 采矿业              | 40,021,230.00    | 0.20          |
| C  | 制造业              | 2,303,461,668.38 | 11.52         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 128,074,233.50   | 0.64          |
| E  | 建筑业              | 157,889,323.62   | 0.79          |
| F  | 批发和零售业           | -                | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 37,347,046.00    | 0.19          |
| H  | 住宿和餐饮业           | 49,218,140.00    | 0.25          |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 25,911,419.00    | 0.13          |
| J  | 金融业              | 173,607,330.62   | 0.87          |
| K  | 房地产业             | 40,347,282.00    | 0.20          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 65,197,314.00    | 0.33          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 25,989,631.65    | 0.13          |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| 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            | 3,082,946,178.77 | 15.42 |

### 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  | 300767 | 震安科技 | 1,179,920  | 123,124,652.00 | 0.62         |
| 2  | 600039 | 四川路桥 | 10,191,015 | 122,699,820.60 | 0.61         |
| 3  | 300059 | 东方财富 | 3,156,742  | 117,146,695.62 | 0.59         |
| 4  | 601012 | 隆基股份 | 1,306,780  | 112,644,436.00 | 0.56         |
| 5  | 603601 | 再升科技 | 8,131,362  | 100,910,202.42 | 0.50         |
| 6  | 002271 | 东方雨虹 | 1,548,200  | 81,559,176.00  | 0.41         |
| 7  | 002475 | 立讯精密 | 1,647,068  | 81,035,745.60  | 0.41         |
| 8  | 601677 | 明泰铝业 | 1,788,495  | 78,854,744.55  | 0.39         |
| 9  | 600893 | 航发动力 | 1,227,809  | 77,916,759.14  | 0.39         |
| 10 | 600176 | 中国巨石 | 4,213,368  | 76,683,297.60  | 0.38         |

### 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 | 142,126,559.20 | 0.71         |

|    |           |                   |       |
|----|-----------|-------------------|-------|
| 2  | 央行票据      | -                 | -     |
| 3  | 金融债券      | 6,137,359,000.00  | 30.71 |
|    | 其中：政策性金融债 | 4,794,707,000.00  | 23.99 |
| 4  | 企业债券      | 6,486,952,000.00  | 32.46 |
| 5  | 企业短期融资券   | 180,002,000.00    | 0.90  |
| 6  | 中期票据      | 1,398,429,000.00  | 7.00  |
| 7  | 可转债（可交换债） | 2,180,050,584.18  | 10.91 |
| 8  | 同业存单      | 272,196,000.00    | 1.36  |
| 9  | 其他        | -                 | -     |
| 10 | 合计        | 16,797,115,143.38 | 84.04 |

注：可转债项下包含可交换债28,679,500.00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  | 210407 | 21农发07 | 10,600,000 | 1,058,304,000.00 | 5.29         |
| 2  | 210304 | 21进出04 | 5,700,000  | 570,171,000.00   | 2.85         |
| 3  | 210215 | 21国开15 | 5,300,000  | 531,696,000.00   | 2.66         |
| 4  | 200312 | 20进出12 | 4,800,000  | 481,680,000.00   | 2.41         |
| 5  | 210211 | 21国开11 | 4,400,000  | 439,604,000.00   | 2.20         |

#### 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，【中国进出口银行】于2021年07月13日收到中国银行保险监督管理委员会出具罚款处罚的通报。

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   | 1,556,549.17   |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 149,768,656.96 |
| 5  | 应收申购款   | 97,504,315.32  |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 248,829,521.45 |

#### 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  | 128081 | 海亮转债 | 76,326,691.35 | 0.38         |
| 2  | 128109 | 楚江转债 | 62,618,737.58 | 0.31         |
| 3  | 128128 | 齐翔转2 | 57,061,850.00 | 0.29         |
| 4  | 127007 | 湖广转债 | 55,791,873.20 | 0.28         |
| 5  | 113025 | 明泰转债 | 51,299,029.80 | 0.26         |
| 6  | 110047 | 山鹰转债 | 44,192,800.00 | 0.22         |
| 7  | 123107 | 温氏转债 | 42,141,970.82 | 0.21         |
| 8  | 110079 | 杭银转债 | 41,098,200.00 | 0.21         |
| 9  | 113591 | 胜达转债 | 38,868,000.00 | 0.19         |
| 10 | 128023 | 亚太转债 | 38,117,600.00 | 0.19         |
| 11 | 110061 | 川投转债 | 38,036,250.00 | 0.19         |
| 12 | 110038 | 济川转债 | 37,776,073.50 | 0.19         |
| 13 | 127018 | 本钢转债 | 36,200,906.82 | 0.18         |
| 14 | 123116 | 万兴转债 | 36,031,302.64 | 0.18         |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 15 | 110053 | 苏银转债   | 35,508,000.00 | 0.18 |
| 16 | 113050 | 南银转债   | 35,496,000.00 | 0.18 |
| 17 | 127029 | 中钢转债   | 35,156,100.00 | 0.18 |
| 18 | 127027 | 靖远转债   | 34,855,333.90 | 0.17 |
| 19 | 128063 | 未来转债   | 34,519,481.15 | 0.17 |
| 20 | 113615 | 金诚转债   | 34,384,020.00 | 0.17 |
| 21 | 110052 | 贵广转债   | 34,025,600.00 | 0.17 |
| 22 | 110066 | 盛屯转债   | 32,635,200.00 | 0.16 |
| 23 | 113051 | 节能转债   | 32,495,400.00 | 0.16 |
| 24 | 110059 | 浦发转债   | 31,695,000.00 | 0.16 |
| 25 | 127020 | 中金转债   | 31,642,205.46 | 0.16 |
| 26 | 113594 | 淳中转债   | 30,082,800.00 | 0.15 |
| 27 | 113593 | 沪工转债   | 29,938,300.00 | 0.15 |
| 28 | 123111 | 东财转3   | 29,936,040.00 | 0.15 |
| 29 | 123110 | 九典转债   | 29,876,348.52 | 0.15 |
| 30 | 127033 | 中装转2   | 29,824,542.00 | 0.15 |
| 31 | 123098 | 一品转债   | 29,170,029.20 | 0.15 |
| 32 | 132018 | G三峡EB1 | 28,679,500.00 | 0.14 |
| 33 | 127013 | 创维转债   | 28,626,609.64 | 0.14 |
| 34 | 128106 | 华统转债   | 28,264,425.00 | 0.14 |
| 35 | 123103 | 震安转债   | 27,494,600.00 | 0.14 |
| 36 | 123114 | 三角转债   | 26,496,400.00 | 0.13 |
| 37 | 127028 | 英特转债   | 26,340,300.00 | 0.13 |
| 38 | 128083 | 新北转债   | 26,249,736.33 | 0.13 |
| 39 | 123067 | 斯莱转债   | 25,570,170.00 | 0.13 |
| 40 | 128105 | 长集转债   | 24,896,833.50 | 0.12 |
| 41 | 127011 | 中鼎转2   | 23,181,452.80 | 0.12 |
| 42 | 128022 | 众信转债   | 23,072,000.00 | 0.12 |
| 43 | 128108 | 蓝帆转债   | 22,034,300.00 | 0.11 |
| 44 | 123052 | 飞鹿转债   | 22,014,027.60 | 0.11 |
| 45 | 123085 | 万顺转2   | 21,199,050.00 | 0.11 |
| 46 | 128069 | 华森转债   | 20,716,249.20 | 0.10 |
| 47 | 128113 | 比音转债   | 18,786,440.40 | 0.09 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 48 | 128076 | 金轮转债 | 17,946,557.88 | 0.09 |
| 49 | 128025 | 特一转债 | 17,850,300.00 | 0.09 |
| 50 | 110048 | 福能转债 | 17,677,800.00 | 0.09 |
| 51 | 128130 | 景兴转债 | 17,357,528.52 | 0.09 |
| 52 | 128017 | 金禾转债 | 15,948,000.00 | 0.08 |
| 53 | 113024 | 核建转债 | 15,658,800.00 | 0.08 |
| 54 | 113625 | 江山转债 | 15,610,642.50 | 0.08 |
| 55 | 128136 | 立讯转债 | 15,146,842.62 | 0.08 |
| 56 | 128082 | 华锋转债 | 14,878,400.00 | 0.07 |
| 57 | 128125 | 华阳转债 | 14,033,430.00 | 0.07 |
| 58 | 113033 | 利群转债 | 13,478,164.80 | 0.07 |
| 59 | 123099 | 普利转债 | 13,295,086.54 | 0.07 |
| 60 | 110072 | 广汇转债 | 12,705,061.20 | 0.06 |
| 61 | 128133 | 奇正转债 | 12,626,000.00 | 0.06 |
| 62 | 128145 | 日丰转债 | 11,648,594.10 | 0.06 |
| 63 | 128144 | 利民转债 | 11,297,129.60 | 0.06 |
| 64 | 110080 | 东湖转债 | 11,188,000.00 | 0.06 |
| 65 | 128117 | 道恩转债 | 11,081,000.00 | 0.06 |
| 66 | 127034 | 绿茵转债 | 10,124,810.50 | 0.05 |
| 67 | 128096 | 奥瑞转债 | 9,907,800.00  | 0.05 |
| 68 | 113545 | 金能转债 | 9,793,300.00  | 0.05 |
| 69 | 128091 | 新天转债 | 9,615,000.00  | 0.05 |
| 70 | 110064 | 建工转债 | 9,250,587.00  | 0.05 |
| 71 | 113585 | 寿仙转债 | 9,214,725.00  | 0.05 |
| 72 | 113589 | 天创转债 | 8,808,674.40  | 0.04 |
| 73 | 113610 | 灵康转债 | 8,785,007.20  | 0.04 |
| 74 | 123073 | 同和转债 | 8,684,147.16  | 0.04 |
| 75 | 123077 | 汉得转债 | 6,749,010.00  | 0.03 |
| 76 | 128124 | 科华转债 | 6,640,704.20  | 0.03 |
| 77 | 110068 | 龙净转债 | 6,610,335.00  | 0.03 |
| 78 | 123113 | 仙乐转债 | 5,988,500.00  | 0.03 |
| 79 | 113616 | 韦尔转债 | 4,963,602.00  | 0.02 |
| 80 | 128141 | 旺能转债 | 3,884,400.00  | 0.02 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 81 | 113519 | 长久转债 | 3,437,734.80 | 0.02 |
|----|--------|------|--------------|------|

#### 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               | 3,398,205,054.15 | 1,933,726,665.24 | 676,834,182.36   |
| 报告期期间基金总申购份额              | 4,281,840,851.37 | 5,060,282,971.00 | 1,199,614,886.83 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 601,455,921.10   | 1,254,431,928.29 | 95,172,482.54    |
| 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               | 7,078,589,984.42 | 5,739,577,707.95 | 1,781,276,586.65 |

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。

### § 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

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》（财会(2017)7号）、《企业会计准则第23号—金融资产转移》（财会(2017)8号）、《企业会计准则第24号—套期会计》（财会(2017)9号）、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（财会(2017)14号）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号）等相关规定，自 2022年1月1日起，天弘基金管理有限公司旗下资产管理产品开始执行新金融工具相关会计准则。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旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告》。

## §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  
二〇二二年一月二十四日