
天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金

2024年第2季度报告

2024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:2024年07月19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2024年07月17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2024年04月01日起至2024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 | 959,382,364.58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 | 456,371,707.29份 | 503,010,657.29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(2024年04月01日 - 2024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 | -25,887,598.06 | -24,857,891.71 |
| 2.本期利润 | 19,716,884.36 | 11,403,064.79 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0361 | 0.0208 |
| 4.期末基金资产净值 | 499,200,063.17 | 538,792,395.14 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0938 | 1.0711 |

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

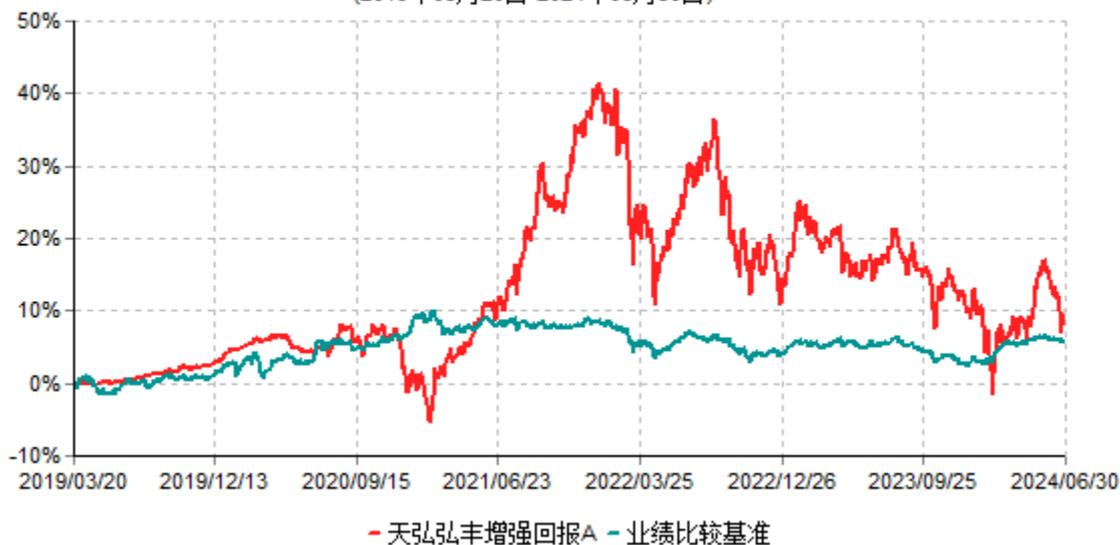
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.84% | 0.81% | 0.44% | 0.14% | 1.40% | 0.67% |
| 过去六个月 | -3.09% | 0.94% | 2.19% | 0.17% | -5.28% | 0.77% |
| 过去一年 | -5.97% | 0.82% | 0.64% | 0.17% | -6.61% | 0.65% |
| 过去三年 | -1.81% | 0.94% | -2.45% | 0.21% | 0.64% | 0.73% |
| 过去五年 | 8.86% | 0.77% | 5.90% | 0.22% | 2.96% | 0.55% |
| 自基金合同生效日起至今 | 9.38% | 0.75% | 5.91% | 0.23% | 3.47% | 0.52% |

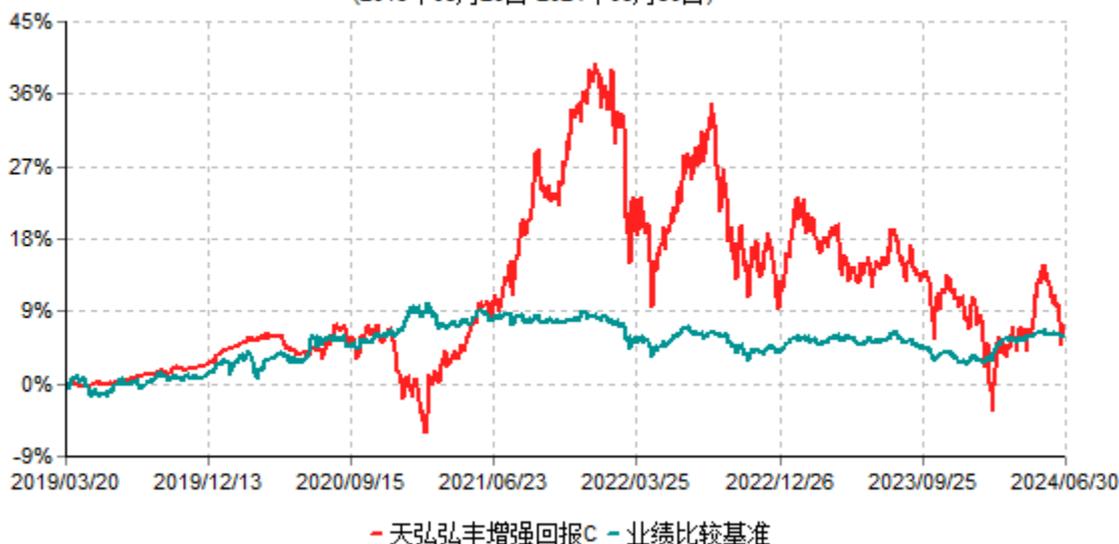
天弘弘丰增强回报C净值表现

| 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 | 1.74% | 0.80% | 0.44% | 0.14% | 1.30% | 0.66% |
| 过去六个月 | -3.29% | 0.94% | 2.19% | 0.17% | -5.48% | 0.77% |
| 过去一年 | -6.34% | 0.82% | 0.64% | 0.17% | -6.98% | 0.65% |
| 过去三年 | -2.97% | 0.94% | -2.45% | 0.21% | -0.52% | 0.73% |
| 过去五年 | 6.72% | 0.77% | 5.90% | 0.22% | 0.82% | 0.55% |
| 自基金合同生效日起至 今 | 7.11% | 0.75% | 5.91% | 0.23% | 1.20% | 0.52% |

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-2024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-2024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 | | |
| 胡东 | 本基金基金经理 | 2024年01月 | - | 7年 | 男，金融专业硕士，2017年7月加盟本公司，历任信用研究部信用研究员、固定收益部可转债研究员。 |
| 杜广 | 本基金基金经理 | 2020年07月 | - | 10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0次，未发生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

市场对经济的预期相对不乐观。在股票上，反映在对水电、运营商、大盘红利型资产的极致抱团；在债券上，反映在对长久期利率债的追逐；在渠道端，反映在对任何低权益含量产品的热衷。

这种一致预期往往对市场并不有利。因为在资本市场中最好的预测方式并非是线性的，而是带着周期性的视角，一个宏大叙事深入人心、抵达顶点，往往是衰落的开始。我们认为资本市场忽视了很多经济改善的事实，以及政策层面上的努力，即便这些改善目前表现温和，但不可否认的是政策层面对于打破经济、尤其是地产负向循环的决心。

我们的组合已经陆续在减持公用事业看空内需的方向，不止是因为高的拥挤度，更是因为相关股票的价格相对于价值已经失去折扣、转为溢价状态。与之相反，我们在建

材、白酒、制造业的细分利基市场的龙头等有加仓的动作，北交所经历了今年的下跌，流动性又几乎陷于枯竭的状态，我们认为也需要高度重视其中的个股机会。

在转债资产中，市场似乎重复了每一轮信用危机+中小盘股票下跌的韵脚，这些故事在2018年，2020年12月都发生过。与前几轮不同的是，在目前的监管环境下，股票的退市风险要更大，因此我们各个组合做了一些梳理和风险的防范。但我们认为市场泥沙俱下并不合理，没有信用风险、退市风险的中小盘低价转债，依然是值得我们在里面进行定价和投资的。长期来看，这部分转债的alpha会因为环境的变化而有所削弱，但是并没有消失。现在是需要在里面积极进行挖掘和定价的时刻。二季度的转债市场犹如我们一季报预测那样，金融监管处于高压与退市常态化使得部分有瑕疵的低价转债市场价格不断下移，但这个过程中也有部分优质转债会被错杀。本基金在上半年的运作中，在一季度就逐步将有瑕疵的转债逐步减仓，并提高了持仓转债的公司质量，才使得在近期低价转债大跌的行情中并没有踩雷。上半年我们重仓的转债中以银行转债和养殖转债为主，这部分转债虽然弹性不大，但也贡献了稳健的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2024年06月30日，天弘弘丰增强回报A基金份额净值为1.0938元，天弘弘丰增强回报C基金份额净值为1.0711元。报告期内份额净值增长率天弘弘丰增强回报A为1.84%，同期业绩比较基准增长率为0.44%；天弘弘丰增强回报C为1.74%，同期业绩比较基准增长率为0.44%。

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 | 208,490,856.27 | 14.73 |
| | 其中：股票 | 208,490,856.27 | 14.73 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,175,407,489.75 | 83.04 |
| | 其中：债券 | 1,175,407,489.75 | 83.04 |
| | 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 | 18,878,657.38 | 1.33 |
| 8 | 其他资产 | 12,630,739.59 | 0.89 |
| 9 | 合计 | 1,415,407,742.99 | 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 | 119,296,401.78 | 11.49 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,979,402.00 | 1.64 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,014.00 | 0.00 |
| 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 | 72,067,078.33 | 6.94 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 143,960.16 | 0.01 |
| 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 | 208,490,856.27 | 20.09 |
|--|----|----------------|-------|

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 | 3,085,350 | 68,062,821.00 | 6.56 |
| 2 | 603279 | 景津装备 | 1,738,712 | 37,712,663.28 | 3.63 |
| 3 | 002271 | 东方雨虹 | 2,976,100 | 36,725,074.00 | 3.54 |
| 4 | 300435 | 中泰股份 | 1,442,600 | 16,979,402.00 | 1.64 |
| 5 | 002100 | 天康生物 | 2,123,000 | 14,712,390.00 | 1.42 |
| 6 | 603313 | 梦百合 | 1,343,640 | 10,036,990.80 | 0.97 |
| 7 | 000425 | 徐工机械 | 1,194,500 | 8,540,675.00 | 0.82 |
| 8 | 600919 | 江苏银行 | 538,931 | 4,004,257.33 | 0.39 |
| 9 | 603757 | 大元泵业 | 209,100 | 3,993,810.00 | 0.38 |
| 10 | 600585 | 海螺水泥 | 101,300 | 2,389,667.00 | 0.23 |

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 | 51,582,149.13 | 4.97 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 18,541,149.07 | 1.79 |
| | 其中：政策性金融债 | 18,541,149.07 | 1.79 |
| 4 | 企业债券 | 10,188,908.49 | 0.98 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,095,095,283.06 | 105.50 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,175,407,489.75 | 113.24 |

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 | 113050 | 南银转债 | 640,000 | 80,263,732.60 | 7.73 |
| 2 | 113060 | 浙22转债 | 590,000 | 73,810,390.13 | 7.11 |
| 3 | 127032 | 苏行转债 | 436,730 | 54,898,277.17 | 5.29 |
| 4 | 127049 | 希望转2 | 500,000 | 51,751,287.67 | 4.99 |
| 5 | 110079 | 杭银转债 | 292,400 | 35,312,338.89 | 3.40 |

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，【杭州银行股份有限公司】于2024年01月09日收到国家金融监督管理总局浙江监管局出具公开处罚的通报；【南京银行股份有限公司】于2023年08月25日收到国家外汇管理局江苏省分局出具公开处罚的通报；【宁波银行股份有限公司】分别于2023年11月27日、2024年06月14日收到国家金融监督管理总局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 | 272,257.58 |
| 2 | 应收证券清算款 | 12,233,327.52 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 5 | 应收申购款 | 125,154.49 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 12,630,739.59 |

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 | 113050 | 南银转债 | 80,263,732.60 | 7.73 |
| 2 | 113060 | 浙22转债 | 73,810,390.13 | 7.11 |
| 3 | 127032 | 苏行转债 | 54,898,277.17 | 5.29 |
| 4 | 127049 | 希望转2 | 51,751,287.67 | 4.99 |
| 5 | 110079 | 杭银转债 | 35,312,338.89 | 3.40 |
| 6 | 123107 | 温氏转债 | 27,763,789.04 | 2.67 |
| 7 | 110083 | 苏租转债 | 26,368,504.26 | 2.54 |
| 8 | 113043 | 财通转债 | 25,565,634.25 | 2.46 |
| 9 | 111015 | 东亚转债 | 25,250,548.44 | 2.43 |
| 10 | 123190 | 道氏转02 | 22,876,135.96 | 2.20 |
| 11 | 113055 | 成银转债 | 22,669,939.73 | 2.18 |
| 12 | 113021 | 中信转债 | 20,086,058.90 | 1.94 |
| 13 | 123126 | 瑞丰转债 | 18,617,940.89 | 1.79 |
| 14 | 110073 | 国投转债 | 18,400,744.11 | 1.77 |
| 15 | 113657 | 再22转债 | 17,116,077.97 | 1.65 |
| 16 | 110077 | 洪城转债 | 14,753,970.96 | 1.42 |
| 17 | 127039 | 北港转债 | 14,511,189.04 | 1.40 |
| 18 | 123132 | 回盛转债 | 14,436,140.41 | 1.39 |
| 19 | 118035 | 国力转债 | 14,339,018.06 | 1.38 |
| 20 | 128074 | 游族转债 | 13,924,083.95 | 1.34 |
| 21 | 127078 | 优彩转债 | 13,192,502.78 | 1.27 |
| 22 | 128066 | 亚泰转债 | 13,129,578.08 | 1.26 |
| 23 | 123234 | 中能转债 | 12,971,501.46 | 1.25 |
| 24 | 113653 | 永22转债 | 12,968,149.46 | 1.25 |
| 25 | 110067 | 华安转债 | 12,200,642.47 | 1.18 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 26 | 123191 | 智尚转债 | 11,896,405.26 | 1.15 |
| 27 | 118012 | 微芯转债 | 11,867,597.67 | 1.14 |
| 28 | 113649 | 丰山转债 | 11,386,416.99 | 1.10 |
| 29 | 113042 | 上银转债 | 11,367,350.69 | 1.10 |
| 30 | 123120 | 隆华转债 | 11,289,614.11 | 1.09 |
| 31 | 111017 | 蓝天转债 | 11,288,228.77 | 1.09 |
| 32 | 123193 | 海能转债 | 11,074,623.21 | 1.07 |
| 33 | 127061 | 美锦转债 | 10,999,344.68 | 1.06 |
| 34 | 123169 | 正海转债 | 10,810,287.67 | 1.04 |
| 35 | 113593 | 沪工转债 | 10,623,394.49 | 1.02 |
| 36 | 127084 | 柳工转2 | 10,465,291.51 | 1.01 |
| 37 | 118039 | 煜邦转债 | 10,020,917.81 | 0.97 |
| 38 | 118036 | XD力合转 | 9,563,629.45 | 0.92 |
| 39 | 128087 | 孚日转债 | 9,315,460.82 | 0.90 |
| 40 | 118043 | 福立转债 | 9,253,529.75 | 0.89 |
| 41 | 113647 | 禾丰转债 | 9,242,222.03 | 0.89 |
| 42 | 123165 | 回天转债 | 8,582,101.01 | 0.83 |
| 43 | 127079 | 华亚转债 | 8,273,036.16 | 0.80 |
| 44 | 123171 | 共同转债 | 8,257,430.14 | 0.80 |
| 45 | 113066 | 平煤转债 | 8,163,058.33 | 0.79 |
| 46 | 123213 | 天源转债 | 7,482,134.79 | 0.72 |
| 47 | 128108 | 蓝帆转债 | 7,105,342.69 | 0.68 |
| 48 | 123217 | 富仕转债 | 7,098,300.82 | 0.68 |
| 49 | 127052 | 西子转债 | 6,780,854.79 | 0.65 |
| 50 | 127026 | 超声转债 | 6,708,838.36 | 0.65 |
| 51 | 127068 | 顺博转债 | 6,502,633.70 | 0.63 |
| 52 | 123214 | 东宝转债 | 6,424,779.75 | 0.62 |
| 53 | 123082 | 北陆转债 | 6,422,489.26 | 0.62 |
| 54 | 127060 | 湘佳转债 | 6,231,960.00 | 0.60 |
| 55 | 123085 | 万顺转2 | 5,796,281.05 | 0.56 |
| 56 | 118029 | 富淼转债 | 5,724,815.34 | 0.55 |
| 57 | 123151 | 康医转债 | 5,677,565.64 | 0.55 |
| 58 | 123160 | 泰福转债 | 5,400,172.60 | 0.52 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 59 | 111004 | 明新转债 | 5,313,191.78 | 0.51 |
| 60 | 127087 | 星帅转2 | 5,180,343.81 | 0.50 |
| 61 | 118006 | 阿拉转债 | 5,161,567.79 | 0.50 |
| 62 | 113058 | 友发转债 | 5,156,348.48 | 0.50 |
| 63 | 111005 | 富春转债 | 4,875,140.44 | 0.47 |
| 64 | 110060 | 天路转债 | 4,557,718.22 | 0.44 |
| 65 | 123211 | 阳谷转债 | 4,430,116.16 | 0.43 |
| 66 | 111016 | 神通转债 | 4,398,379.18 | 0.42 |
| 67 | 127051 | 博杰转债 | 4,368,213.70 | 0.42 |
| 68 | 113644 | 艾迪转债 | 4,306,350.68 | 0.41 |
| 69 | 113065 | 齐鲁转债 | 4,217,911.81 | 0.41 |
| 70 | 118024 | 冠宇转债 | 4,097,768.96 | 0.39 |
| 71 | 118011 | 银微转债 | 3,945,980.39 | 0.38 |
| 72 | 110094 | 众和转债 | 3,697,876.44 | 0.36 |
| 73 | 123144 | 裕兴转债 | 3,696,301.37 | 0.36 |
| 74 | 118037 | 上声转债 | 3,578,901.37 | 0.34 |
| 75 | 123187 | 超达转债 | 3,528,171.78 | 0.34 |
| 76 | 123152 | 润禾转债 | 3,466,610.96 | 0.33 |
| 77 | 113666 | 爱玛转债 | 3,423,908.22 | 0.33 |
| 78 | 127099 | 盛航转债 | 3,420,183.29 | 0.33 |
| 79 | 123076 | 强力转债 | 3,278,783.85 | 0.32 |
| 80 | 123113 | 仙乐转债 | 3,010,700.00 | 0.29 |
| 81 | 113606 | 荣泰转债 | 2,911,461.87 | 0.28 |
| 82 | 113679 | 芯能转债 | 2,655,576.71 | 0.26 |
| 83 | 123221 | 力诺转债 | 2,578,103.01 | 0.25 |
| 84 | 127070 | 大中转债 | 2,357,969.86 | 0.23 |
| 85 | 113664 | 大元转债 | 2,338,270.69 | 0.23 |
| 86 | 123133 | 佩蒂转债 | 2,259,972.60 | 0.22 |
| 87 | 128109 | 楚江转债 | 2,216,530.41 | 0.21 |
| 88 | 128130 | 景兴转债 | 2,156,789.04 | 0.21 |
| 89 | 123174 | 精锻转债 | 2,149,980.82 | 0.21 |
| 90 | 118022 | 锂科转债 | 1,984,164.38 | 0.19 |
| 91 | 123093 | 金陵转债 | 1,728,176.71 | 0.17 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 92 | 113636 | 甬金转债 | 1,594,609.59 | 0.15 |
| 93 | 113545 | 金能转债 | 1,547,292.55 | 0.15 |
| 94 | 113608 | 威派转债 | 1,503,947.67 | 0.14 |
| 95 | 127059 | 永东转2 | 1,357,844.04 | 0.13 |
| 96 | 110062 | 烽火转债 | 1,203,224.97 | 0.12 |
| 97 | 123117 | 健帆转债 | 1,134,463.01 | 0.11 |
| 98 | 127044 | 蒙娜转债 | 981,091.78 | 0.09 |
| 99 | 127062 | 垒知转债 | 766,646.01 | 0.07 |
| 100 | 128063 | 未来转债 | 603,305.42 | 0.06 |
| 101 | 128125 | 华阳转债 | 544,123.29 | 0.05 |
| 102 | 111010 | 立昂转债 | 9,960.39 | 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 | 723,414,428.45 | 579,086,806.07 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 5,574,171.33 | 101,578,340.06 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 272,616,892.49 | 177,654,488.84 |
| 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 | 456,371,707.29 | 503,010,657.29 |

§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
二〇二四年七月十九日