

# 天弘基金严选之平安红FOF五期集合资产管理计划

## 2021年第2季度投资报告

2021年06月30日

资产管理人：天弘基金管理有限公司  
资产托管人：国泰君安证券股份有限公司  
报告送出日期：二〇二一年七月三十日

## § 1 投资组合概况

|              |                         |
|--------------|-------------------------|
| 投资组合名称       | 天弘基金严选之平安红FOF五期集合资产管理计划 |
| 资产管理计划成立日    | 2020年09月22日             |
| 报告期末投资组合资产总值 | 49,370,482.57元          |
| 报告期末投资组合份额总额 | 48,740,749.96份          |
| 资产管理人        | 天弘基金管理有限公司              |
| 资产托管人        | 国泰君安证券股份有限公司            |

## § 2 主要财务指标和投资组合净值表现

### 2.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标     | 报告期<br>(2021年04月01日 -2021年06月30日) |
|------------|-----------------------------------|
| 本期已实现收益    | 59,853.04                         |
| 本期利润       | 1,185,937.36                      |
| 期末投资组合资产净值 | 49,276,022.57                     |

### 2.2 资产管理计划的利润分配情况

单位:人民币元

| 年度       | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 利润分配合计 | 备注 |
|----------|----------|-----------|--------|----|
| 2021年2季度 | 0.00     | 0.00      | 0.00   |    |

## § 3 履职报告

### 3.1 管理人履职报告

#### 3.1.1 公平交易制度的执行情况

资产管理人公平对待所管理的投资组合,制定《公平交易制度》、《异常交易监控和报告办法》,对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行监控和分析,对不同投资组合之间发生的同向、反向交易进行监控和分析。严格禁止同一投资组合在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

#### 3.1.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,严格控制同一投资组合或不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。报告期内未发生同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 3.1.3 报告期内投资组合的投资策略和运作分析

上半年市场环境的剧烈变化给产品的投资管理带来了极大挑战,既考验投资

经理对投资理念的坚定程度，也考验投资方法是否能够灵活应对调整。反思和总结上半年的经验教训，我们看到过去一年取得成功的投资方法在今年不能简单复制，而适度与市场做逆向操作也有助于在上半年取得更好的投资回报。

二季度产品权益仓位基本保持稳定，5月份适度增加了权益配置比例，穿透后的权益仓位保持在中枢位置10%左右；产品结构上适度偏向前期跌幅较大的行业。

向后展望，风险偏好等因素催化下的窗口期趋于结束，需要重视市场可能的调整风险；同时中报业绩成为市场焦点，局部结构性机会预计强于指数整体表现，重点关注中报业绩有望超预期板块。“短期业绩验证改善”+“中期相对业绩趋势占优”+“长期增长逻辑不变”仍是后续投资的主要思路。

### 3.1.4 报告期内投资组合的业绩表现

截至2021年06月30日，本投资组合份额净值为1.0110元，本报告期份额净值增长率2.46%。

## 3.2 托管人履职报告

### 3.2.1 报告期内本计划托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本计划托管人在对天弘基金严选之平安红FOF五期集合资产管理计划托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害投资人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

### 3.2.2 托管人对报告期内本计划投资运作遵规守信、净值计算等情况的说明

本报告期内，天弘基金严选之平安红FOF五期集合资产管理计划管理人--天弘基金管理有限公司在天弘基金严选之平安红FOF五期集合资产管理计划的投资运作、净值计算、费用开支等问题上，不存在任何损害投资人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照资产管理合同的规定进行。

### 3.2.3 托管人对本季度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘基金严选之平安红FOF五期集合资产管理计划季度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 4 投资组合报告

### 4.1 报告期末投资组合资产组合情况

| 序号 | 项目      | 金额（元）         | 占计划总资产的比例（%） |
|----|---------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资    | 0.00          | 0.00         |
|    | 其中：股票   | 0.00          | 0.00         |
| 2  | 资管产品投资  | 44,143,300.81 | 89.41        |
| 3  | 固定收益投资  | 0.00          | 0.00         |
|    | 其中：债券   | 0.00          | 0.00         |
|    | 资产支持证券  | 0.00          | 0.00         |
| 4  | 金融衍生品投资 | 0.00          | 0.00         |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
|   | 其中：权证             | 0.00          | 0.00   |
| 5 | 买入返售金融资产          | 0.00          | 0.00   |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 0.00          | 0.00   |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计      | 225,215.81    | 0.46   |
| 7 | 其他各项资产            | 5,001,965.95  | 10.13  |
| 8 | 合 计               | 49,370,482.57 | 100.00 |

#### 4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 4.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本投资组合本报告期末未持有境内股票。

##### 4.2.2 报告期末按行业分类的境外股票投资组合

本投资组合本报告期末未持有境外股票。

#### 4.3 报告期末按公允价值占投资组合资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本投资组合本报告期末未持有股票。

#### 4.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本投资组合本报告期末未持有债券。

#### 4.5 报告期末按公允价值占投资组合资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本投资组合本报告期末未持有债券。

#### 4.6 报告期末按公允价值占投资组合资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本投资组合本报告期末未持有资产支持证券。

#### 4.7 报告期末按公允价值占投资组合资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本投资组合本报告期末未持有权证。

#### 4.8 报告期末本投资组合投资的股指期货交易情况说明

本投资组合本报告期末未持有股指期货。

#### 4.9 报告期末本投资组合投资的国债期货交易情况说明

本投资组合本报告期末未持有国债期货。

#### 4.10 报告期末按公允价值占计划资产净值比例大小排序的资管产品投资明细

| 序号 | 产品代码   | 产品名称             | 持有份额(份)      | 公允价值(元)      | 占计划资产净值比例(%) |
|----|--------|------------------|--------------|--------------|--------------|
| 1  | A04219 | 平安资产创赢112号资产管理产品 | 6,536,854.30 | 9,235,267.76 | 18.74        |

|    |        |                     |              |              |       |
|----|--------|---------------------|--------------|--------------|-------|
| 2  | 008646 | 天弘增利A               | 5,358,328.63 | 5,568,375.11 | 11.30 |
| 3  | 006646 | 汇添富短<br>债A          | 4,654,909.78 | 5,022,647.65 | 10.19 |
| 4  | 007823 | 天弘弘择<br>短债A         | 2,826,783.16 | 3,026,919.41 | 6.14  |
| 5  | 008383 | 招商安心<br>收益A         | 1,511,971.23 | 2,532,249.42 | 5.14  |
| 6  | 519782 | 交银裕隆<br>纯债A         | 2,032,853.10 | 2,530,698.82 | 5.14  |
| 7  | 003949 | 兴全稳泰A               | 2,363,077.99 | 2,528,966.06 | 5.13  |
| 8  | 519718 | 交银纯债<br>AB          | 2,338,475.06 | 2,517,368.40 | 5.11  |
| 9  | 000147 | 易方达高<br>等级信用<br>债A  | 2,245,289.93 | 2,514,724.72 | 5.10  |
| 10 | 100058 | 富国产业<br>债A          | 1,794,918.29 | 2,060,745.69 | 4.18  |
| 11 | 004200 | 博时富瑞<br>纯债A         | 1,926,747.47 | 2,044,086.39 | 4.15  |
| 12 | 007616 | 富国投资<br>级信用债A       | 1,923,965.83 | 1,969,948.61 | 4.00  |
| 13 | 001447 | 天弘惠利                | 591,138.05   | 1,025,092.49 | 2.08  |
| 14 | 001222 | 鹏华外延<br>成长          | 213,720.51   | 546,910.79   | 1.11  |
| 15 | 002593 | 富国美丽<br>中国A         | 173,955.09   | 523,082.96   | 1.06  |
| 16 | 008515 | 富兰克林<br>国海基本<br>面优选 | 309,651.50   | 496,216.53   | 1.01  |

#### 4.11 投资组合报告附注

##### 4.11.1 其他资产构成

| 序号 | 名称    | 金额（元） |
|----|-------|-------|
| 1  | 存出保证金 | 0.00  |

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 5,000,000.00 |
| 3 | 应收股利    | 0.00         |
| 4 | 应收利息    | 1,965.95     |
| 5 | 应收申购款   | 0.00         |
| 6 | 其他应收款   | 0.00         |
| 7 | 其他      | 0.00         |
| 8 | 合 计     | 5,001,965.95 |

#### 4.11.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本投资组合本报告期末未持有可转换债券。

#### 4.11.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本投资组合本报告期末未持有股票。

#### 4.11.4 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。

### § 5 报告期末管理人从业人员及关联方等持有份额情况

单位：份

|                            |      |
|----------------------------|------|
| 管理人自有资金投资持有本投资组合份额         | 0.00 |
| 管理人董事、监事、从业人员及其配偶持有本投资组合份额 | 0.00 |
| 管理人控股股东等关联方持有本投资组合份额       | 0.00 |

### § 6 运用杠杆情况说明

本报告期内，本计划杠杆比例为100.19%，不超过法律法规及本计划资产管理合同约定的最高杠杆比例要求。

### § 7 涉及投资者权益的重大事项

#### 7.1 投资经理

本报告期内，投资经理未发生变更。

#### 7.2 重大关联交易

本报告期内，本计划未发生重大关联交易。

#### 7.3 投资于管理人旗下资管产品情况

本报告期内，本计划投资于管理人旗下资管产品如下：

| 序号 | 产品代码   | 产品名称        | 本报告期买入份<br>额（份） | 本报告期末持<br>有份额（份） |
|----|--------|-------------|-----------------|------------------|
| 1  | 001447 | 天弘惠利混合      | 591,138.05      | 591,138.05       |
| 2  | 007823 | 天弘弘择短债<br>A | 940,545.66      | 2,826,783.16     |

## § 8 管理费、托管费、投资顾问费等费用的计提

### 8.1 管理费计提情况

本报告期，本计划计提48,344.89元管理费。

### 8.2 托管费计提情况

本报告期，本计划计提2,417.29元托管费。

### 8.3 投资顾问费计提情况

本报告期，本计划计提36,258.72元投资顾问费。

天弘基金管理有限公司  
二〇二一年七月三十日