

天弘基金严选之平安股票FOF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股票FOF集合资产管理计划
资产管理计划成立日	2020年08月19日
报告期末投资组合资产总值	24,087,449.30元
报告期末投资组合份额总额	22,255,112.00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 (2021年04月01日 -2021年06月30日)
本期已实现收益	-81,359.62
本期利润	1,712,862.19
期末投资组合资产净值	23,922,479.02

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

过去半年,产品操作有成功之处,亦有不足之处。总体来说,上涨阶段产品

较好地把握了市场的主流机会，以相对较低的股票仓位（约 60%）获取了不低于市场涨幅的收益。但在春节后，因为产品在核心资产上的布局过高，下行波动较大，虽然回撤相较其他权益产品来说并不算大，但是触及了面值，影响了投资人的持有体验。因为缺少安全垫，我们在 3 月开始的这波反弹过程中只能逐步增加权益仓位，所以反弹初期略显乏力。二季度市场的反弹趋势延续时间较长，结构分明，产品在单位净值达到 1.02 元后我们果断增加权益品种持仓获取收益。

5 月开始，一方面我们大幅增加核心持仓的权重，选择 alpha 获取超额收益。同时，在基本面景气度向好的新能源、光伏和芯片板块我们通过场内基金增加配置，效果显著。但因为宏观经济增速下行，流动性边际收紧趋势不变，而 A 股呈现结构性高估的特征，我们并不看多权益的整体机会。产品自 6 月最后一周开始，逐步小幅减持阶段性涨幅过大的芯片 ETF，降低了整体的权益仓位。同时，逐步开始通过场内基金开始配置港股互联网，相较于 A 股的核心资产和科技板块的估值，港股互联网龙头估值更为合理。虽然政策高压下，不排除板块有进一步下行的风险，所以我们在仓位操作上会非常谨慎，等待市场给予正反馈后择机增加权重。

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1.0749元，本报告期份额净值增长率7.71%。

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股票FOF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股票FOF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股票FOF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股票FOF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	22,861,924.99	94.91
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	1,223,538.79	5.08
7	其他各项资产	1,985.52	0.01
8	合计	24,087,449.30	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	2,705,491.26	3,822,318.05	15.98
2	001532	华安文体 健康主题	1,033,465.03	3,474,509.43	14.52
3	008383	招商安心 收益A	1,513,804.81	2,535,320.30	10.60
4	550016	信诚至远C	540,121.22	2,185,330.46	9.14
5	007192	恒越研究 精选C	582,947.88	1,664,083.02	6.96
6	006299	恒越核心 精选A	558,695.27	1,605,578.47	6.71
7	006049	恒越研究 精选A	395,076.93	1,132,448.51	4.73
8	005233	广发睿毅 领先A	251,129.65	666,623.66	2.79
9	003834	华夏能源 革新	168,711.71	569,739.44	2.38
10	002190	农银汇理 新能源主 题	162,094.52	560,944.30	2.34
11	006253	永赢消费 主题C	133,525.61	522,258.72	2.18
12	002340	富国价值 优势	130,968.29	521,646.70	2.18
13	004235	中欧价值 智选回报C	107,314.56	501,695.57	2.10
14	008901	富国内需 增长	265,136.02	495,539.22	2.07
15	513330	华夏恒生 互联网科 技业ETF	594,500.00	495,218.50	2.07
16	377240	上投摩根	65,883.46	445,240.42	1.86

		新兴动力A			
17	001717	工银瑞信 前沿医疗A	84,846.16	428,218.57	1.79
18	163415	兴全商业 模式优选	104,000.00	411,216.00	1.72
19	001956	国联安科 技动力	136,215.12	337,527.45	1.41
20	A02696	平安资产 鑫福9号资 产管理产 品	171,301.52	228,225.02	0.95
21	000960	招商医药 健康产业	63,377.12	224,291.63	0.94
22	A02706	平安资产 如意37号 资产管理 产品	33,951.55	33,951.55	0.14

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	1,388.11
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	118.75
4	应收利息	478.66
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	0.00
7	其他	0.00
8	合 计	1,985.52

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	400,000.00
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100.69%，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，本计划未投资于管理人旗下资管产品。

§ 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56,394.50元管理费。

8.2 托管费计提情况

本报告期，本计划计提1,127.94元托管费。

8.3 投资顾问费计提情况

本报告期，本计划计提16,918.30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