

天弘安康颐养混合型证券投资基金

2021年第3季度报告

2021年09月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2021年10月27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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月25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07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-------------|--------------------------------------------------------------------------------------|-----------|
| 基金简称 | 天弘安康颐养混合 | |
| 基金主代码 | 420009 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2012年11月28日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,708,765,401.98份 | |
| 投资目标 | 本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的价值型股票，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值，为投资者提供稳健的养老理财工具。 | |
| 投资策略 | 资产配置策略、债券等固定收益类资产的投资策略、股票投资策略、权证投资策略、存托凭证投资策略。 | |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率（税后）+0.75% | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券投资为主的混合型基金，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 天弘基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 天弘安康颐养混合A | 天弘安康颐养混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 420009 | 009308 |

| | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 731,567,395.23份 | 977,198,006.75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07月01日 - 2021年09月30日) | |
|-----------------|--------------------------------|------------------|
| | 天弘安康颐养混合A | 天弘安康颐养混合C |
| 1. 本期已实现收益 | 25,084,880.06 | 16,723,112.57 |
| 2. 本期利润 | 13,701,228.68 | 7,119,006.31 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0222 | 0.0097 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,485,617,968.95 | 1,133,157,371.17 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.0307 | 1.1596 |

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

天弘安康颐养混合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 | 1.18% | 0.20% | 0.67% | 0.01% | 0.51% | 0.19% |
| 过去六个月 | 4.73% | 0.19% | 1.34% | 0.01% | 3.39% | 0.18% |
| 过去一年 | 8.07% | 0.21% | 2.71% | 0.01% | 5.36% | 0.20% |
| 过去三年 | 33.60% | 0.22% | 8.59% | 0.01% | 25.01% | 0.21% |
| 过去五年 | 40.83% | 0.20% | 15.18% | 0.01% | 25.65% | 0.19% |
| 自基金合同生效日 | 103.07% | 0.23% | 34.70% | 0.01% | 68.37% | 0.22% |

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

天弘安康颐养混合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 | 1.19% | 0.20% | 0.86% | 0.01% | 0.33% | 0.19% |
| 过去六个月 | 4.66% | 0.19% | 1.72% | 0.01% | 2.94% | 0.18% |
| 过去一年 | 7.87% | 0.21% | 3.49% | 0.01% | 4.38% | 0.20% |
| 自基金份额首次确认日起至今 | 15.96% | 0.24% | 5.19% | 0.01% | 10.77% | 0.23% |

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

天弘安康颐养混合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
(2012年11月28日-2021年09月30日)



天弘安康颐养混合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



注：1、本基金合同于2012年11月28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04月14日起增设天弘安康颐养混合C基金份额。天弘安康颐养混合C基金份额的首次确认日为2020年04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 | | |
| 王华 | 本基金基金经理 | 2021年09月 | - | 11年 | 男，金融学专业硕士。历任招商基金管理有限公司风险管理部资深经理、深圳睿泉毅信投资管理有限公司研究部高级研究员、招商基金管理有限公司研究部研究员、投资管理一部基金经理助理、投资经 |

| | | | | | |
|-----|----------------------------------------|----------|---|-----|--------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | | 理，2021年2月加盟本公司，历任基金经理助理。 |
| 于洋 | 股票投资研究部总经理助理、本基金基金经理 | 2021年02月 | - | 10年 | 男，环境科学博士。2011年7月加盟本公司，从事化工、电力及公用事业等行业研究工作，历任研究员、投资研究部总经理助理。 |
| 姜晓丽 | 固定收益机构投资部总经理、固定收益部总经理、宏观研究部总经理、本基金基金经理 | 2013年01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不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 报告期内基金的投资策略和运作分析

权益投资上，3季度的调整不多。我们总体上坚持选股风格偏稳健，行业方面偏向大消费、大制造。个股方面我们会选择有强竞争壁垒、或者未来很可能成长为有强竞争壁垒的优秀企业进行长期投资，这些企业随着经济的发展而价值增长以及股价上涨是大概率的事情。

2021年4季度市场的不确定性比较多，疫情发展、国内外经济走向、市场流动性、国际关系等。

其中疫情是一个非常重要的独立的变量。疫情依然可能持续反复，从而影响国内经济。同时如果药物研发顺利，海外疫情控制住了，也会对各个行业产生影响，有些是正面的，有些是负面的，也有一些我们现在还看不出来，需要重点跟踪的。

面对不确定性，我们选择的方法是强化对于行业长期前景和公司核心竞争优势的研究，以长期保护短期，用所投资资产的长期价值来构建更深的安全边际。

在争取长期收益的同时，我们也会努力控制股票的波动和回撤。一方面分散行业配置降低整体波动，另一方面重视风险分析，回避基本面有风险的公司。

三季度，债券市场自身的商业周期已经进入到剩余流动性驱动的行市，特点为宏观胜率已经处于历史较高区间，债券估值会从中性偏贵整体向极贵演进，此阶段机构高位运行，高波动高换手，缺少趋势性机会，交易性机会集中在情绪和技术周期范畴。

我们在这个阶段，选择剩余流动性驱动周期的合适策略，以较高的仓位和中性偏高的久期来应对。以中性偏高组合票息来保持组合净值的固定收益，不输时间；同时积极调整组合流动性分布，以较为安全的组合流动性状况来应对较低的交易赔率，在估值、仓位极致区域抛出交易性仓位，以防范经济周期的均值回复，不输空间。

展望四季度，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。我们倾向认为国内货币政策将更多关注宏观经济的“量”，因此以政策利率为核心的公开市场操作将尽可能满足金融机构流动性需求，债券市场的估值-carry交易还将有效，但应该警惕未来某个时间的一个较大的风险：通胀从上游传导到下游的过程，一旦形成全面通胀预期，宏观状态可能进入到“滞涨”的状态，在这个状态下，我们将会对债券部分的组合进一步收缩久期并提高组合流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2021年09月30日，天弘安康颐养混合A基金份额净值为2.0307元，天弘安康颐养混合C基金份额净值为1.1596元。报告期内份额净值增长率天弘安康颐养混合A为

1.18%，同期业绩比较基准增长率为0.67%；天弘安康颐养混合C为1.19%，同期业绩比较基准增长率为0.86%。

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 | 235,786,997.51 | 8.52 |
| | 其中：股票 | 235,786,997.51 | 8.52 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,437,614,536.10 | 88.05 |
| | 其中：债券 | 2,437,614,536.10 | 88.05 |
| | 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 | 44,470,729.76 | 1.61 |
| 8 | 其他资产 | 50,604,417.40 | 1.83 |
| 9 | 合计 | 2,768,476,680.77 | 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 | 18,116.82 | 0.00 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 184,024,636.67 | 7.03 |
| D | 电力、热力、燃气及水生 生产和供应业 | 6,804,709.00 | 0.26 |
| E | 建筑业 | 20,183.39 | 0.00 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|------|
| F | 批发和零售业 | 77,729.83 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 40,233.44 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,636,328.47 | 0.06 |
| J | 金融业 | 23,219,035.60 | 0.89 |
| K | 房地产业 | 1,054,766.25 | 0.04 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,773,891.64 | 0.22 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 13,108,413.78 | 0.50 |
| 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 | 8,952.62 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 235,786,997.51 | 9.00 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 14,900 | 27,267,000.00 | 1.04 |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 98,000 | 21,500,220.00 | 0.82 |
| 3 | 603816 | 顾家家居 | 297,200 | 17,832,000.00 | 0.68 |
| 4 | 300767 | 震安科技 | 147,580 | 16,086,220.00 | 0.61 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 288,300 | 14,544,735.00 | 0.56 |
| 6 | 002415 | 海康威视 | 252,400 | 13,882,000.00 | 0.53 |
| 7 | 600323 | 瀚蓝环境 | 493,200 | 13,069,800.00 | 0.50 |
| 8 | 603601 | 再升科技 | 1,024,334 | 12,240,791.30 | 0.47 |
| 9 | 603899 | 晨光文具 | 162,800 | 11,067,144.00 | 0.42 |
| 10 | 002508 | 老板电器 | 279,600 | 9,450,480.00 | 0.36 |

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 | 74,220,738.60 | 2.83 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 510,800,000.00 | 19.51 |
| | 其中：政策性金融债 | 500,660,000.00 | 19.12 |
| 4 | 企业债券 | 1,394,122,000.00 | 53.24 |
| 5 | 企业短期融资券 | 20,104,000.00 | 0.77 |
| 6 | 中期票据 | 231,554,000.00 | 8.84 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 206,813,797.50 | 7.90 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,437,614,536.10 | 93.08 |

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 | 210211 | 21国开11 | 1,800,000 | 179,568,000.00 | 6.86 |
| 2 | 190205 | 19国开05 | 1,000,000 | 101,300,000.00 | 3.87 |
| 3 | 210407 | 21农发07 | 1,000,000 | 99,720,000.00 | 3.81 |
| 4 | 149473 | 21金街02 | 800,000 | 80,480,000.00 | 3.07 |
| 5 | 210206 | 21国开06 | 800,000 | 80,048,000.00 | 3.06 |

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，【国家开发银行】于2020年12月25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；【华泰证券股份有限公司】于2020年11月23日收到中国证券监督管理委员会江苏监管局出具警示函的通报。

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 | 74,476.25 |
| 2 | 应收证券清算款 | 11,562,752.40 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 27,662,794.43 |
| 5 | 应收申购款 | 11,304,394.32 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 50,604,417.40 |

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 | 110064 | 建工转债 | 18,343,968.60 | 0.70 |
| 2 | 128081 | 海亮转债 | 15,919,219.20 | 0.61 |
| 3 | 113519 | 长久转债 | 13,448,344.00 | 0.51 |
| 4 | 110047 | 山鹰转债 | 10,555,548.90 | 0.40 |
| 5 | 113033 | 利群转债 | 10,377,000.00 | 0.40 |
| 6 | 113535 | 大业转债 | 9,737,430.00 | 0.37 |
| 7 | 128023 | 亚太转债 | 9,660,988.50 | 0.37 |
| 8 | 128097 | 奥佳转债 | 9,533,810.40 | 0.36 |
| 9 | 113563 | 柳药转债 | 9,185,224.00 | 0.35 |
| 10 | 113025 | 明泰转债 | 8,704,546.20 | 0.33 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 11 | 123077 | 汉得转债 | 7,944,169.24 | 0.30 |
| 12 | 123070 | 鹏辉转债 | 7,081,650.00 | 0.27 |
| 13 | 113545 | 金能转债 | 7,052,000.00 | 0.27 |
| 14 | 128128 | 齐翔转2 | 6,719,530.88 | 0.26 |
| 15 | 123004 | 铁汉转债 | 6,318,134.64 | 0.24 |
| 16 | 127016 | 鲁泰转债 | 5,218,117.60 | 0.20 |
| 17 | 128139 | 祥鑫转债 | 4,489,600.00 | 0.17 |
| 18 | 110059 | 浦发转债 | 4,439,035.20 | 0.17 |
| 19 | 123078 | 飞凯转债 | 3,860,326.80 | 0.15 |
| 20 | 128120 | 联诚转债 | 3,329,026.20 | 0.13 |
| 21 | 113017 | 吉视转债 | 3,084,122.00 | 0.12 |
| 22 | 113530 | 大丰转债 | 2,883,248.70 | 0.11 |
| 23 | 110063 | 鹰19转债 | 2,337,460.40 | 0.09 |
| 24 | 110053 | 苏银转债 | 2,335,200.00 | 0.09 |
| 25 | 113591 | 胜达转债 | 2,201,180.40 | 0.08 |
| 26 | 128037 | 岩土转债 | 2,170,200.00 | 0.08 |
| 27 | 113528 | 长城转债 | 1,776,376.80 | 0.07 |
| 28 | 123010 | 博世转债 | 1,766,044.04 | 0.07 |

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

| | 天弘安康颐养混合A | 天弘安康颐养混合C |
|-------------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 527,378,600.47 | 525,006,217.12 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 265,834,971.21 | 600,499,436.20 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 61,646,176.45 | 148,307,646.57 |
| 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 | 731,567,395.23 | 977,198,006.75 |

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

单位：份

| | 天弘安康颐养混合A | 天弘安康颐养混合C |
|--------------------------|---------------|-----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 90,771,558.25 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 90,771,558.25 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 12.41 | - |

注：报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自级别的份额总额计算。

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

| 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%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20210701-20210811 | 281,135,147.14 | - | - | 281,135,147.14 | 16.45% |
| 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。

注：份额占比精度处理方式四舍五入。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》法律法规及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。

在本报告截止日至报告批准送出日之间，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定，与基金托管人协商一致，决定自 2021年10月20日起增加天弘安康颐养混合型证券投资基金E类基金份额并相应修改基金合同等法律文件。具体信息请参见基金管理人在指定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于天弘安康颐养混合型证券投资基金增设份额并相应修改相关法律文件的公告》。

§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安康养老混合型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘安康颐养混合型证券投资基金基金合同
- 3、天弘安康颐养混合型证券投资基金托管协议
- 4、天弘安康颐养混合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
二〇二一年十月二十七日