

天弘基金严选之平安红FOF六期集合资产管理计划

2021年第3季度投资报告

2021年09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：二〇二一年十月二十九日

§ 1 投资组合概况

| | |
|--------------|-------------------------|
| 投资组合名称 | 天弘基金严选之平安红FOF六期集合资产管理计划 |
| 资产管理计划成立日 | 2020年10月28日 |
| 报告期末投资组合资产总值 | 80,265,535.23元 |
| 报告期末投资组合份额总额 | 76,983,187.32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07月01日 -2021年09月30日) |
|------------|-----------------------------------|
| 本期已实现收益 | 243,756.57 |
| 本期利润 | 947,170.76 |
| 期末投资组合资产净值 | 80,107,373.99 |

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3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制度》,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。

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,并对多个组合间同日及临近日同向交易的价差强化控制和监测。

3.1.3 报告期内投资组合的投资策略和运作分析

三季度,产品股债配置比例基本保持稳定。产品的债券资产结构上保持以纯债基金为主,以打新基金为代表的二级债基为辅,且在本季度后期纯债部分减仓了中短期纯债基金,增配了中长期纯债基金;穿透后股票结构上维持“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”的调整思路。7月底逆向小幅增加了股票配置比例，8月份，股票结构上维持对新能源、军工、周期资源等高景气板块的超配。9月股票资产结构上进行了适度均衡，少量加仓了前期回调比较充分的医药消费板块，但仍维持对新能源、周期资源等高景气板块的略超配。

后续股票结构上会在领先与落后板块之间保持均衡，随着上游价格局部见顶，配置也逐步往中下游开始调整。制造成长赛道中线前景未变，短期注意把控节奏；消费成长赛道可能在逐步进入调整尾声，自下而上择股逐步布局，包括家电、轻工家居、食品饮料、医药等；逐步减配前期因供给受限逻辑上涨较多的上游周期板块，布局受稳增长政策预期支持的水泥、中游机械等板块。

3.1.4 报告期内投资组合的业绩表现

截至2021年09月30日，本投资组合份额净值为1.0406元，本报告期份额净值增长率1.20%。

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六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六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六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六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 | 79,258,776.53 | 98.75 |
| 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 | 1,004,309.72 | 1.25 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,448.98 | 0.00 |
| 8 | 合计 | 80,265,535.23 | 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 | A02983 | 平安资产鑫福72号资产管理产品 | 13,206,242.86 | 13,004,187.34 | 16.23 |

| | | | | | |
|----|--------|------------------------------|-------------------|---------------|-------|
| 2 | A02960 | 平安资产 鑫福71号 资产管理 产品 | 11,279,602.2 0 | 12,994,101.73 | 16.22 |
| 3 | A04219 | 平安资产 创赢112号 资产管理 产品 | 8,305,901.53 | 12,326,788.46 | 15.39 |
| 4 | 003949 | 兴全稳泰 债券A | 7,621,412.24 | 8,253,227.31 | 10.30 |
| 5 | 006804 | 富国短债 债券A | 7,000,000.00 | 7,627,200.00 | 9.52 |
| 6 | A02244 | 平安资产 如意28号 资产管理 产品 | 2,324,435.92 | 5,912,202.76 | 7.38 |
| 7 | A04883 | 平安资产 创赢150号 资产管理 产品 | 4,495,594.32 | 5,335,371.34 | 6.66 |
| 8 | 008646 | 天弘增利 短债债券A | 3,891,149.62 | 4,082,594.18 | 5.10 |
| 9 | 004200 | 博时富瑞 纯债债券A | 2,862,829.58 | 3,068,667.03 | 3.83 |
| 10 | 000147 | 易方达高 等级信用 债债券A | 2,247,309.09 | 2,530,470.04 | 3.16 |
| 11 | 519782 | 交银裕隆 纯债债券A | 1,624,219.72 | 2,045,379.89 | 2.55 |
| 12 | 002593 | 富国美丽 中国混合A | 348,014.44 | 1,047,523.46 | 1.31 |
| 13 | 001447 | 天弘惠利 混合 | 591,138.05 | 1,031,062.99 | 1.29 |

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 | 0.00 |
| 3 | 应收股利 | 0.00 |
| 4 | 应收利息 | 2,448.98 |
| 5 | 应收申购款 | 0.00 |
| 6 | 其他应收款 | 0.00 |
| 7 | 其他 | 0.00 |
| 8 | 合计 | 2,448.98 |

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100.20%，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。

7.4 投资于投资顾问管理的资管产品情况

本报告期内，本计划投资于投资顾问管理的资管产品如下：

| 序号 | 产品代码 | 产品名称 | 本报告期买入份 | 本报告期末持 |
|----|------|------|---------|--------|
|----|------|------|---------|--------|

| | | | 额（份） | 有份额（份） |
|---|--------|--------------------------|------------|------------|
| 1 | A04572 | 平安资产创赢 138号资产管理 产品 | 9,678,668 | 0 |
| 2 | A04883 | 平安资产创赢 150号资产管理 产品 | 4,495,594 | 4,495,594 |
| 3 | A02244 | 平安资产如意 28号资产管理 产品 | 2,324,436 | 2,324,436 |
| 4 | A02960 | 平安资产鑫福 71号资产管理 产品 | 11,279,602 | 11,279,602 |
| 5 | A02983 | 平安资产鑫福 72号资产管理 产品 | 13,206,243 | 13,206,243 |

§ 8 费用计提

8.1 管理费计提情况

本报告期，本计划计提80,387.18元管理费。

8.2 托管费计提情况

本报告期，本计划计提4,019.33元托管费。

8.3 投资顾问费计提情况

本报告期，本计划计提60,290.37元投资顾问费。

天弘基金管理有限公司
二〇二一年十月二十九日