

天弘基金严选之平安股票FOF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	13,043,107.63元
报告期末投资组合份额总额	11,844,043.53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	1,603,126.19
本期利润	185,713.66
期末投资组合资产净值	12,952,440.39

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,产品在股票仓位上保持中性谨慎,股票中枢保持在50-60%,通过谨慎的仓位降低市场风险暴露。7月,通过集中持仓,布局新能源车、光伏,辅之以军工和半导体,产品上行表现出了较好弹性,而对于市场调整又有较好的免疫

力。8月我们进入第二个考核年度，为了向投资者提供正收益，产品从安全垫做起。幸运的是，我们选择的下层品种表现不错。9月，市场和板块波动加大，风格有所切换。前期强势的新能源板块表现不佳，而长期以来受资本市场冷落的煤炭板块自8月下旬以来超额收益显著。今年以来表现持续不佳的大消费板块在涨价预期和资金筹码流动过程中表现抢眼。后期产品的亏损主要来自于新能源车和光伏，但是长期来看我们选择的管理人是优秀的，而这两个行业也将维持较高的增速，所以将维持这部分持仓。整体配置以成长为主，行业主要分布在我们认为长期成长性更好的大消费、医药、TMT和先进制造几个方向上。

展望后市，在没有新的宏观变量的前提下，产品现有的配置思路：以成长投资为基石，均衡配置于成长性较好的几大行业赛道；同时，以景气度和资金筹码结构为线索对产品做调整；并通过持续挖掘优秀管理人努力创造alpha收益。

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1.0936元，本报告期份额净值增长率1.74%。

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	11,729,513.47	89.93
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	830,755.48	6.37
7	其他各项资产	482,838.68	3.70
8	合 计	13,043,107.63	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	A02639	平安资产鑫福19号资产管理	3,068,736.04	3,161,411.87	24.41

		产品			
2	008383	招商安心 收益债券A	1,227,379.54	2,087,649.86	16.12
3	006049	恒越研究 精选混合A	395,076.93	1,110,442.73	8.57
4	001532	华安文体 健康混合A	266,585.98	1,052,748.04	8.13
5	010685	工银前沿 医疗股票C	153,686.00	741,996.01	5.73
6	001877	宝盈国家 安全沪港 深股票A	322,143.87	539,977.55	4.17
7	007412	景顺长城 绩优成长 混合	280,226.27	503,006.15	3.88
8	008657	景顺长城 科技创新 混合	316,660.54	485,978.93	3.75
9	008133	华安优质 生活混合	308,927.54	391,349.41	3.02
10	002943	广发多因 子混合	108,359.86	388,448.43	3.00
11	090018	大成新锐 产业混合	60,496.96	385,305.14	2.97
12	006257	信达澳银 先进智造 股票	88,538.02	284,782.54	2.20
13	002296	长城行业 轮动混合A	100,923.38	267,174.46	2.06
14	A02696	平安资产 鑫福9号资 产管理产 品	171,301.52	203,197.86	1.57
15	513330	华夏恒生	146,000.00	91,834.00	0.71

		互联网科技业 ETF(QDII)			
16	A02706	平安资产 如意37号 资产管理 产品	34,210.49	34,210.49	0.26

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	3,253.94
2	应收证券清算款	478,939.06
3	应收股利	131.68
4	应收利息	514.00
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	0.00
7	其他	0.00
8	合计	482,838.68

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100.70%，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 额（份）	本报告期末持 有份额（份）
1	A04883	平安资产创赢 150号资产管 理产品	863,260	0
2	A02639	平安资产鑫福 19号资产管理 产品	3,068,736	3,068,736

§ 8 费用计提

8.1 管理费计提情况

本报告期，本计划计提48,843.51元管理费。

8.2 托管费计提情况

本报告期，本计划计提976.92元托管费。

8.3 投资顾问费计提情况

本报告期，本计划计提14,653.02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