

天弘基金严选之平安红FOF稳健一期

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稳健一期集合资产管理计划
资产管理计划成立日	2020年09月09日
报告期末投资组合资产总值	10,540,075.41元
报告期末投资组合份额总额	10,050,636.84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	19,052.40
本期利润	45,259.19
期末投资组合资产净值	10,514,129.03

### 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。严

#### 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

本季度天弘基金严选之平安红 FOF 稳健一期产品在维持较为均衡的配置基础上做了小幅的基金替换,整体产品的穿透后股票仓位仍然维持 9%-10%之间,比上个季度仓位略有下降。整体产品还是以结构调整为主,产品久期维持在 1.7 左右

的中性久期。9月底的这波调整，使得产品的净值略有损伤，但我们认为幅度较为充分，因此在当下时间点产品没有减持股票仓位，而是持续调整结构，同时将底层配置的基金经理进行换仓操作，希望在未来市场的反弹中能够抓住结构性的反弹方向和机会。

进入四季度收官阶段，我们判断四季度可能的风格是基本面预期和相对估值均处低位的价值会有相对收益。因为政策协调效果显现后，预计市场对经济的悲观预期会明显好转，四季度经济边际上好于三季度，这是年末A股行情的基础，国内宏观流动性会继续保持合理充裕，季初机构调仓效应驱动资金向低位价值转移，基本面预期和相对估值均处低位的板块配置价值更高。

产品配置方面，除了维持部分均衡型选手的配置，还会将配置方向转向低估值类资产，同时，对景气度维持很高、业绩增速很快的新能源车等领域也需要维持一定的底仓，并关注年底估值切换的行情。并且投资经理会对阶段性涨幅过快的资产进行阶段性止盈以控制产品回撤。

### 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1.0461元，本报告期份额净值增长率0.50%。

### 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稳健一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稳健一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稳健一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稳健一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	8,836,033.95	83.83

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	1,703,333.38		16.16
7	其他各项资产	708.08		0.01
8	合 计	10,540,075.41		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	001035	中银恒利	853,544.19	1,044,738.09	9.94

		半年定期 开放债券			
2	040041	华安纯债 债券C	943,218.26	1,014,808.53	9.65
3	000338	鹏华双债 保利债券	799,168.66	991,288.81	9.43
4	006647	添富短债 债券C	843,170.32	906,998.31	8.63
5	000692	汇添富双 利债券C	293,083.24	533,704.58	5.08
6	005665	鹏扬景欣 混合C	332,977.87	523,308.02	4.98
7	004739	上投摩根 安隆回报 混合C	391,726.73	509,518.96	4.85
8	004586	鹏扬汇利 债券C	443,262.41	505,186.17	4.80
9	003280	鹏华丰恒 债券	428,468.65	472,472.38	4.49
10	007848	广发聚宝 混合C	278,009.45	413,455.65	3.93
11	003328	万家鑫璟 纯债债券C	341,209.59	397,065.60	3.78
12	009610	天弘永利 债券C	285,279.57	311,240.01	2.96
13	008106	博时富瑞 纯债债券C	278,835.47	298,688.56	2.84
14	008792	招商安华 债券C	276,548.67	296,404.86	2.82
15	180026	银华信用 双利债券C	243,704.30	296,100.72	2.82
16	003154	华宝新活 力混合	68,064.25	107,936.29	1.03
17	002088	国富新机	68,228.81	107,255.69	1.02

		遇混合C			
18	004260	德邦稳盈 增长灵活 配置混合	88,811.01	105,862.72	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	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	708.08
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	0.00
7	其他	0.00
8	合 计	708.08

##### 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100.25%，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，本计划未投资于投资顾问管理的资管产品。

## **§ 8 费用计提**

### **8.1 管理费计提情况**

本报告期，本计划计提10,259.01元管理费。

### **8.2 托管费计提情况**

本报告期，本计划计提512.92元托管费。

### **8.3 投资顾问费计提情况**

本报告期，本计划计提7,694.25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