

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4季度投资报告

2021年12月31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：二〇二二年一月二十八日

§ 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	9,976,307.70元
报告期末投资组合份额总额	9,381,849.71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10月01日 -2021年12月31日)
本期已实现收益	54,789.32
本期利润	131,846.80
期末投资组合资产净值	9,948,249.30

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4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

2021年四季度,资本市场经历了跌宕起伏,但整体向上而行、成长风格占优。产品在第四季度整体运行平稳,维持以均衡型二级债基为主体的配置,择机增持了底层部分受益于“稳增长”的二级债基。维持穿透后11%左右的中性偏低

权益仓位。债券基金方面，仍以中性久期的债券型基金为主，在四季度阶段性增持了长久期利率债基金，并在利率下行陡峭的阶段进行了止盈，获得了不错的绝对收益。向后展望，经济名义上的高增长已结束，利率长期趋势仍是下行格局。如果未来在逆周期政策刺激或者风险偏好上升等冲击下导致利率上行，债券市场将迎来较好的长线配置机会。

展望 2022 年，我们认为整体经济增速承压，流动性继续宽松，但是无论对经济基本面还是流动性均不应该抱有太高的预期，2022 年大概率仍是震荡市。产品计划保持中性略偏高的权益风险暴露，在风格层面上维持整体均衡配置。从 FOF 投资的角度来看，赛道型机会在 2022 年不再明显，需要精选擅长精选个股的基金，回避对纯赛道基金的配置。

3.1.4 报告期内投资组合的业绩表现

截至2021年12月31日，本投资组合份额净值为1.0604元，本报告期份额净值增长率1.37%。

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	9,813,091.43	98.36
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	163,144.41	1.64
7	其他各项资产	71.86	0.00
8	合计	9,976,307.70	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	中银恒利半年定期开放债券	853,544.19	1,056,687.71	10.62

2	040041	华安纯债 债券C	943,218.26	1,015,846.07	10.21
3	000338	鹏华双债 保利债券	799,168.66	983,137.29	9.88
4	009735	天弘增强 回报债券E	739,098.30	918,847.01	9.24
5	006647	添富短债 债券C	843,170.32	907,672.85	9.12
6	000692	汇添富双 利债券C	293,083.24	542,790.16	5.46
7	005665	鹏扬景欣 混合C	332,977.87	530,067.47	5.33
8	004586	鹏扬汇利 债券C	443,262.41	516,578.01	5.19
9	004739	上投摩根 安隆回报 混合C	391,726.73	514,963.96	5.18
10	003280	鹏华丰恒 债券	428,468.65	474,657.57	4.77
11	007848	广发聚宝 混合C	278,009.45	422,435.36	4.25
12	003328	万家鑫璟 纯债债券C	341,209.59	402,149.62	4.04
13	009610	天弘永利 债券C	285,279.57	311,325.59	3.13
14	008792	招商安华 债券C	276,548.67	306,830.75	3.08
15	008106	博时富瑞 纯债债券C	278,835.47	293,083.96	2.95
16	180026	银华信用 双利债券C	243,704.30	289,277.00	2.91
17	003154	华宝新活 力混合	68,064.25	109,222.70	1.10

18	002088	国富新机遇混合C	68,228.81	109,097.87	1.10
19	004260	德邦稳盈增长灵活配置混合	88,811.01	108,420.48	1.09

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	71.86
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	0.00
7	其他	0.00
8	合计	71.86

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100.28%，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，本计划投资于管理人旗下资管产品如下：

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	009735	天弘增强回报 债券E	739,098.30	739,098.30

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10,032.43元管理费。

8.2 托管费计提情况

本报告期，本计划计提501.64元托管费。

8.3 投资顾问费计提情况

本报告期，本计划计提7,524.33元投资顾问费。

天弘基金管理有限公司
二〇二二年一月二十八日