

# 天弘基金严选之平安红FOF三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三期集合资产管理计划
资产管理计划成立日	2020年05月27日
报告期末投资组合资产总值	106,608,576.66元
报告期末投资组合份额总额	92,113,996.04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	27,356.88
本期利润	1,583,130.85
期末投资组合资产净值	106,417,360.66

### 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

四季度,产品股债配置比例基本保持稳定,在开放期对组合部分结构进行了微调。固收资产结构上,保持中长期纯债基金为主,二级债基为辅;考虑到信用债市场风险,10月适当减配信用挖掘策略的纯债基金;11月初判断债市利空出

尽，增配中长期债基，拉长组合整体久期；12月，增配二级债基，减仓收益增厚不及预期的打新策略基金。权益资产方面，由于市场风格切换较快，缺乏明确的结构化行情，基金赚钱效应不佳，四季度减仓了新能源、周期资源等前期高景气板块的主题基金，加仓全市场均衡风格的股票型基金。

展望2022年，“经济下行+政策托底”或将是宏观经济的核心线索。在纯债基金方面，精选利率波段操作强，谨慎信用下沉的管理人；二级债基方面，精选具备资产配置能力、股票投资稳健的子基金管理人。股票型基金方面，选取投资方法论成熟、具备穿越牛熊潜质的管理人旗下基金作为核心底仓，中长期布局科技、高端制造、消费医药等优质成长赛道主题基金。

### 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1.1553元，本报告期份额净值增长率1.72%。

## 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三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三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三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三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	95,796,239.54	89.86
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	10,809,085.82	10.14
7	其他各项资产	3,251.30	0.00
8	合计	106,608,576.66	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	21,381,818.61	21,317,673.15	20.03
2	A02960	平安资产鑫福71号	18,266,881.94	21,306,491.09	20.02

		资产管理 产品			
3	A04219	平安资产 创赢112号 资产管理 产品	10,453,761.1 6	16,084,156.92	15.11
4	A04883	平安资产 创赢150号 资产管理 产品	7,002,907.32	8,583,463.50	8.07
5	003949	兴全稳泰 债券A	4,728,407.95	5,194,628.97	4.88
6	519782	交银裕隆 纯债债券A	4,070,259.71	5,115,095.38	4.81
7	A02244	平安资产 如意28号 资产管理 产品	1,862,251.26	4,894,927.44	4.60
8	270048	广发纯债 债券A	2,467,901.85	3,013,308.16	2.83
9	001447	天弘惠利 混合	1,182,748.81	2,140,420.52	2.01
10	008383	招商安心 收益债券A	1,205,547.35	2,080,774.73	1.96
11	000147	易方达高 等级信用 债债券A	1,803,338.66	2,034,166.01	1.91
12	519718	交银纯债 债券发起 A/B	1,874,531.67	2,022,807.13	1.90
13	008792	招商安华 债券C	1,810,118.56	2,008,326.54	1.89

#### 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	3,251.30
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	0.00
7	其他	0.00
8	合计	3,251.30

##### 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100.18%，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	A02244	平安资产如意 28号资产管理 产品	680,683.71	1,862,251.26
2	A02960	平安资产鑫福 71号资产管理 产品	4,297,378.60	18,266,881.94
3	A02983	平安资产鑫福 72号资产管理 产品	5,027,652.09	21,381,818.61

## § 8 费用计提

### 8.1 管理费计提情况

本报告期，本计划计提96,231.11元管理费。

### 8.2 托管费计提情况

本报告期，本计划计提4,811.56元托管费。

### 8.3 投资顾问费计提情况

本报告期，本计划计提72,173.33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