

# 天弘基金严选之平安股票FOF集合资产管理计划

## 2022年第2季度投资报告

2022年06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：二〇二二年七月二十九日

## § 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 | 11,874,337.18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<br>(2022年04月01日 -2022年06月30日) |
|------------|-----------------------------------|
| 本期已实现收益    | -234,471.16                       |
| 本期利润       | 180,037.58                        |
| 期末投资组合资产净值 | 11,832,132.98                     |

### 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 |
|----------|----------|-----------|--------|----|
| 2022年2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

二季度,债市维持震荡走势。进入4月,国内疫情带动市场对货币政策预期升温,利率下行;但4月中降息落空,降准低于预期,利率转为上行,债市下跌。5月,资金面延续宽松,长端利率横盘2.8%,直至5月下旬稳经济大盘会议后

市场下修对经济预期，10年国债快速下至2.70%，债市整体大幅收涨。进入6月，上海加速复工复产、高频地产销售表现较好，叠加隔夜利率边际抬升，长端调整上行，债市下跌。A股则在二季度走出“V型”反弹，4月份股票市场再次向下调整，沪深300、上证指数等主要宽基指数在4月26日下调至年内低点，之后在利好政策持续推动，叠加上海、北京等地疫情出现拐点，市场复工复产有序推进下，A股市场对外信息反应逐步钝化，走出了连续反弹态势。

投资操作上，基于对市场保持谨慎的观点，3月至4月产品持续减仓权益，4月末穿透后权益仓位不足四成。结构上主要降低一季度配置的稳增长方向，使得整个结构更为均衡。5月及6月持续小幅提高权益资产比例至六成左右，增加了全市场均衡风格产品的配置。市场在经历5月至6月V型反弹后，结构严重分化，短期内本产品拟维持现有仓位，等待强势板块的适度调整整固。

展望后市，下半年稳增长政策预计仍将持续推出，随着经济预期上修，A股盈利端也将环比逐步改善；流动性方面，国内货币政策的总基调预计仍将延续宽松，对权益资产的估值水平仍有支持。在后续无新增风险因素的情况下，我们预期三季度权益指数运行中枢是震荡上移的过程。疫情状况、企业复工复产进度、稳增长政策落地情况、信贷恢复情况、全球通胀走势、地缘政治风险等仍是下一阶段的主要关注点。

### 3.1.4 报告期内投资组合的业绩表现

截至2022年06月30日，本投资组合份额净值为0.9990元，本报告期份额净值增长率1.5450%。

## 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            | 11,254,513.88 | 94.78  |
| 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      | 619,823.30    | 5.22   |
| 7 | 其他各项资产            | 0.00          | 0.00   |
| 8 | 合 计               | 11,874,337.18 | 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投资组合资产净值比例大小排名的前十名资管产品投资明细

| 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号资产管理产品 | 3,068,736.04 | 2,891,056.22 | 24.43        |
| 2  | 008383 | 招商安心收益债券A       | 943,159.44   | 1,658,923.14 | 14.02        |
| 3  | 008270 | 大成睿享混合C         | 547,416.19   | 670,530.09   | 5.67         |
| 4  | 519702 | 交银趋势优先混合A       | 120,171.17   | 519,427.87   | 4.39         |
| 5  | 005001 | 交银持续成长主题混合      | 224,885.84   | 515,145.99   | 4.35         |
| 6  | 011933 | 工银战略远见混合C       | 522,152.39   | 507,479.91   | 4.29         |
| 7  | 010710 | 安信医药健康股票C       | 381,206.60   | 499,761.85   | 4.22         |
| 8  | 010761 | 华商甄选回报混合        | 358,904.19   | 426,306.40   | 3.60         |
| 9  | 540003 | 汇丰晋信动态策略混合A     | 62,784.40    | 306,494.61   | 2.59         |
| 10 | 005938 | 工银精选金融地产混合C     | 204,192.76   | 294,303.02   | 2.49         |

#### 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  | 0.00 |
| 5 | 应收申购款 | 0.00 |
| 6 | 其他应收款 | 0.00 |
| 7 | 其他    | 0.00 |
| 8 | 合 计   | 0.00 |

#### 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，本计划杠杆比例符合资产管理合同约定，杠杆比例未主动超过法规要求的上限。

### § 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 投资管理人旗下资管产品情况

本报告期内，本计划未投资管理人旗下资管产品。

#### 7.4 投资投资顾问管理的资管产品情况

本报告期内，本计划未投资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28,215.73元管理费。

#### 8.2 托管费计提情况

本报告期，本计划计提564.34元托管费。

### **8.3 管理人业绩报酬计提情况**

本计划报告期间无管理人业绩报酬。

### **8.4 投资顾问费计提情况**

本报告期，本计划计提8,464.73元投资顾问费。

### **8.5 投资顾问业绩报酬计提情况**

本计划报告期间无投资顾问业绩报酬。

天弘基金管理有限公司  
二〇二二年七月二十九日