

天弘安康颐利混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年08月29日复核了本报告中的财务指标、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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年04月15日起至2022年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘安康颐利混合型证券投资基金	
基金简称	天弘安康颐利混合	
基金主代码	013267	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年04月15日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	194,579,107.57份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘安康颐利混合A	天弘安康颐利混合C
下属分级基金的交易代码	013267	013268
报告期末下属分级基金的份额总额	109,967,110.32份	84,611,997.25份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的价值型股票，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值，为投资者提供稳健的理财工具。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略，通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益，并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报，在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上，力争实现基金资产的持续稳定增值。主要投资策略包括：资产配置策略、债券等固定收益类资产的投资策略、股票投资策略、金融衍生品投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×13%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)×2%+中证全债指数收益率×85%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、

	投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有 风险。
--	--------------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	童建林	田东辉
	联系电话	022-83310208	010-68858113
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		95046	95580
传真		022-83865569	010-68858120
注册地址		天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦2 3层	北京市西城区金融大街3号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	北京市西城区金融大街3号A 座
邮政编码		300203	100808
法定代表人		韩歆毅	刘建军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际 经济贸易中心A座16层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年04月15日(基金合同生效日)-20 22年06月30日)	
	天弘安康颐利混合 A	天弘安康颐利混合 C
本期已实现收益	585,041.01	427,640.54
本期利润	1,476,455.69	1,133,132.83
加权平均基金份额本期利润	0.0127	0.0108
本期加权平均净值利润率	1.26%	1.08%
本期基金份额净值增长率	1.33%	1.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	576,243.04	409,384.99
期末可供分配基金份额利润	0.0052	0.0048
期末基金资产净值	111,427,529.39	85,701,478.09
期末基金份额净值	1.0133	1.0129
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.33%	1.29%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘安康颐利混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.96%	0.17%	1.25%	0.16%	-0.29%	0.01%
自基金合同生效日起至 今	1.33%	0.12%	1.68%	0.20%	-0.35%	-0.08%

天弘安康颐利混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.95%	0.17%	1.25%	0.16%	-0.30%	0.01%
自基金合同生效日起至 今	1.29%	0.12%	1.68%	0.20%	-0.39%	-0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

天弘安康颐利混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



天弘安康颐利混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同于2022年04月15日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。
2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2022年04月15日至2022年10月14日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、深圳、四川、浙江设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2022年6月30日，公司共管理运作160只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜晓丽	固定收益业务总监、本基金基金经理，兼任固定收益部、宏观研究部、混合资产部总经理	2022年04月	-	13年	女，经济学硕士。历任本公司债券研究员兼债券交易员、光大永明人寿保险有限公司债券研究员兼交

					易员。2011年8月加盟本公司，历任固定收益研究员、基金经理助理等。
贺剑	本基金基金经理	2022 年04 月	-	15 年	男，金融学硕士。历任华夏基金管理有限公司风险分析师、研究员等，2020年5月加盟本公司。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因不公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年上半年的市场复杂程度在过去10来年里都算比较突出的，对投资也形成了很大的挑战。回顾年初，我们有预期上半年的经济因为基数原因整体往下走，但我们也相信比较宽松的货币政策和管理层把工作做到前面的考虑可以对冲这种风险，因此我们的主要精力用在寻找各类细分资产的超额收益上来。因为是固收+组合，我们从比较长期的观点出发，认为保持必要的权益仓位和合理偏低的估值，组合的长期收益是能够反映出来的。但是上半年的一系列外部冲击打破了市场的正常运行轨迹。不管是地缘政治冲突还是疫情的反复，相关细节不用赘述。我们知道，历史都是由一系列的具体事件所组成，但身处其中的人却很难明了事情本身的意义和其衍生性。从2022年上半年的市场运行轨迹来看，我们深刻认识到自身的局限性，大部分基金经理的能力圈只限于资本市场本身的运行机制，而当外部运行生态受到冲击时，大部分的影响是很难避免。也因为认识到自身的局限性，更坚定了我们的信念，即努力学习自己不熟悉的领域，至少做到同步跟踪，同时尽量强化自己有相对优势的领域；正如我们一直以来的对中国资本市场的发展长期乐观的态度，我们相信保持定力，能够穿越市场的波动，争取相对合理的回报。

从市场表现来看，波动较大，我们的一个收获是，对固收+组合来说，管理波动很重要，但高质量的确定性较强的成长价值同样重要。从组合持仓来看，整体呈现行业均衡配置、估值有一定保护。转债仓位相对稳定，主要考虑在股票和转债之间有个合理的搭配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2022年06月30日，天弘安康颐利混合A基金份额净值为1.0133元，天弘安康颐利混合C基金份额净值为1.0129元。报告期内份额净值增长率天弘安康颐利混合A为1.33%，同期业绩比较基准增长率为1.68%；天弘安康颐利混合C为1.29%，同期业绩比较基准增长率为1.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

看政策，我们能大致比较把握的是，控疫情和稳增长的重心摆布在结构上是有变化的，不管是重要领导的谈话还是对于出行政策的调整，都是很明确的信号。我们认为，疫情防控还是很复杂很有必要的事情，但也需要经济发展的物质基础支持，叠加比较复杂的国际国内形势，稳增长的重要性是不言而喻的，因为今年做好经济工作的有效时间

已经过去了不少。相比于消费这种慢变量，投资端的发力是更容易见到效果。从投资端来看，制造业有赖于出口需求的维持和受疫情冲击后投资信心的恢复；从库存数据上来看，我们谨慎乐观，我们希望能有比较强的鼓励投资的政策推出；地产的数据在大量优惠政策和资金利率的支持下，销量有了环比改善，但仍有一些值得紧密跟踪的地方，相应地产产业链能否被带动起来还是有一定压力；基建发力的空间还是有的，老基建、新基建都有不少可以做的事情。整体来说，我们的经济动员机制是自上而下的，所以我们对稳增长还是要有必要的信心。

就行业和公司而言，上半年大多数企业盈利都在往下走，下半年可能会有较大的不同。上半年基于经济本身不太强劲的增长和疫情的复杂形势，我们的仓位更多在价值和估值上有所侧重，但必须承认，这只是阶段性的防御，二级市场的投资还是要看对未来的预期，为有能力或有潜力的公司鼓掌，相应的我们的投资在往下的时间里会把更多的权重放在成长和盈利的兑现上。我们的成长和盈利并不局限于简单的新半军，对于从上游能源、养殖到下游消费，只要是在赔率和胜率这两个维度上都比较适合或组合起来比较合适的品种，都会纳入我们的框架，我们的持有期也相对较长。我们前期布局的养殖类股票近期表现较好，近期的猪价上涨一定程度上略超我们的预期，对猪周期是否见底还有一定的争论，但对养殖股来说，可能已经过了前期比较纠结的涨预期的阶段，后面的走势更多的跟周期的高度和公司自身的基本面相关。2022年商品和资源类股票也有比较大的波动，映射到A股，主要是煤炭股的涨幅比较大；下半年考虑到外围形势，PPI的担忧可能有所缓解，可以关注成本改善的相关行业的布局机会。

展望后续市场，我们关注的问题仍聚焦于市场结构、合理的风险收益比、以及选取更加优质的公司上。

下半年债市持震荡观点，预计收益在票息附近，纯债的机会来自于事件冲击后的收益上行或利差扩大；转债估值目前不算便宜，但仍有望能获得正收益；股票市场以长期持有预期收益较高流动性较好的优质中大盘股作为重点，主要争取业绩兑现带来的收益。

组合将在风险可控的水平下，稳健操作，珍惜投资人的每一分钱，为投资人谋求长期稳健的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委

员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘安康颐利混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘安康颐利混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	2,341,697.41
结算备付金		83,737,529.90
存出保证金		143,431.37
交易性金融资产	6.4.7.2	121,185,107.24
其中：股票投资		36,634,294.99
基金投资		-
债券投资		84,550,812.25
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		748.00

应收申购款		34,536.74
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		207,443,050.66
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		8,748,403.01
应付清算款		870,874.91
应付赎回款		490,781.48
应付管理人报酬		98,625.46
应付托管费		32,875.15
应付销售服务费		14,526.77
应付投资顾问费		-
应交税费		216.37
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	57,740.03
负债合计		10,314,043.18
净资产:		
实收基金	6.4.7.7	194,579,107.57
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	2,549,899.91
净资产合计		197,129,007.48
负债和净资产总计		207,443,050.66

注：1. 报告截止日2022年06月30日，天弘安康颐利混合型证券投资基金A类基金份额净值1.0133元，天弘安康颐利混合型证券投资基金C类基金份额净值1.0129元；基金

份额总额194,579,107.57份，其中天弘安康颐利混合型证券投资基金A类基金份额109,967,110.32份，天弘安康颐利混合型证券投资基金C类基金份额84,611,997.25份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2022年04月15日(基金合同生效日)至2022年06月30日，无上一年度可比期间(下同)。

6.2 利润表

会计主体：天弘安康颐利混合型证券投资基金

本报告期：2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年04月15日（基金合同 生效日）至2022年06月30 日
一、营业总收入		3,051,261.44
1. 利息收入		341,014.76
其中：存款利息收入	6.4.7.9	206,318.23
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		134,696.53
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,052,342.77
其中：股票投资收益	6.4.7.10	467,719.18
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	391,747.07
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	192,876.52
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,596,906.97
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	60,996.94
减：二、营业总支出		441,672.92
1. 管理人报酬		279,235.12
2. 托管费		93,078.37
3. 销售服务费		44,188.37
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		4,024.89
其中：卖出回购金融资产支出		4,024.89
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		44.64
8. 其他费用	6.4.7.19	21,101.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,609,588.52
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,609,588.52
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		2,609,588.52

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天弘安康颐利混合型证券投资基金

本报告期：2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	254,290,908. 59	-	-	254,290,908. 59
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	254,290,908. 59	-	-	254,290,908. 59
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-59,711,801. 02	-	2,549,899.91	-57,161,901. 11
(一)、综合收益总额	-	-	2,609,588.52	2,609,588.52
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-59,711,801. 02	-	-59,688.61	-59,771,489. 63
其中:1.基金申购款	2,764,340.54	-	15,704.92	2,780,045.46
2.基金赎回款	-62,476,141. 56	-	-75,393.53	-62,551,535. 09
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	194,579,107. 57	-	2,549,899.91	197,129,007. 48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘安康颐利混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2021]2415号《关于准予天弘安康颐利混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘安康颐利混合型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币254,264,905.03元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第0315号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘安康颐利混合型证券投资基金合同》于2022年4月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为254,290,908.59份基金份额,其中认购资金利息折合26,003.56份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《天弘安康颐利混合型证券投资基金合同》和《天弘安康颐利混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的差异,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购、赎回基金时收取认购/申购费用、赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为天弘安康颐利混合型证券投资基金A类基金份额(以下简称“A类基金份额”);在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为天弘安康颐利混合型证券投资基金C类基金份额(以下简称“C类基金份额”)。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额及C类基金份额分别计算并公告基金份额净值和基金份额累计净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘安康颐利混合型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行或上市的股票(含主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资债券、可转换债券、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金股票资产占基金资产的比例为0-30%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%);每个交易日日终扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的

规定。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×13%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)×2%+中证全债指数收益率×85%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘安康颐利混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年04月15日(基金合同生效日)至2022年06月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2022年06月30日的财务状况以及2022年04月15日(基金合同生效日)至2022年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2022年04月15日(基金合同生效日)至2022年06月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，

那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交

易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85

号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2022年06月30日	
活期存款	2,341,697.41	
等于：本金	2,341,087.99	
加：应计利息	609.42	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	2,341,697.41	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	35,514,056.98	-	36,634,294.99	1,120,238.01

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	54,401,898.74	279,583.29	55,155,600.99	474,118.96
	银行间市场	29,325,450.00	67,211.26	29,395,211.26	2,550.00
	合计	83,727,348.74	346,794.55	84,550,812.25	476,668.96
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		119,241,405.72	346,794.55	121,185,107.24	1,596,906.97

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	300.03
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	36,738.47
其中：交易所市场	35,963.47
银行间市场	775.00
应付利息	-
预提费用	20,701.53
合计	57,740.03

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘安康颐利混合A

金额单位：人民币元

项目 (天弘安康颐利混合A)	本期 2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	124,879,298.43	124,879,298.43
本期申购	1,260,970.66	1,260,970.66
本期赎回（以“-”号填列）	-16,173,158.77	-16,173,158.77
本期末	109,967,110.32	109,967,110.32

6.4.7.7.2 天弘安康颐利混合C

金额单位：人民币元

项目 (天弘安康颐利混合C)	本期 2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	129,411,610.16	129,411,610.16
本期申购	1,503,369.88	1,503,369.88
本期赎回（以“-”号填列）	-46,302,982.79	-46,302,982.79
本期末	84,611,997.25	84,611,997.25

注：1、申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

2、本基金合同于2022年04月15日生效，基金合同生效日的基金份额总额为254,290,908.59份基金份额，其中认购资金利息折合26,003.56份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 天弘安康颐利混合A

单位：人民币元

项目 (天弘安康颐利混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	585,041.01	891,414.68	1,476,455.69
本期基金份额交易产生的变动数	-8,797.97	-7,238.65	-16,036.62
其中：基金申购款	3,826.70	6,586.26	10,412.96
基金赎回款	-12,624.67	-13,824.91	-26,449.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	576,243.04	884,176.03	1,460,419.07

6.4.7.8.2 天弘安康颐利混合C

单位：人民币元

项目 (天弘安康颐利混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	427,640.54	705,492.29	1,133,132.83
本期基金份额交易产生的变动数	-18,255.55	-25,396.44	-43,651.99
其中：基金申购款	2,246.25	3,045.71	5,291.96
基金赎回款	-20,501.80	-28,442.15	-48,943.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	409,384.99	680,095.85	1,089,480.84

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30

	日
活期存款利息收入	122,372.76
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	83,875.81
其他	69.66
合计	206,318.23

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
卖出股票成交总额	5,745,315.62
减：卖出股票成本总额	5,229,434.18
减：交易费用	48,162.26
买卖股票差价收入	467,719.18

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年 06月30日
债券投资收益——利息收入	304,892.60
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	86,854.47
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	391,747.07

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	64,138,871.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	63,372,189.21
减：应计利息总额	678,341.09
减：交易费用	1,486.39
买卖债券差价收入	86,854.47

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	192,876.52
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	192,876.52
----	------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	1,596,906.97
——股票投资	1,120,238.01
——债券投资	476,668.96
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,596,906.97

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
基金赎回费收入	60,949.19
基金转换费收入	47.75
合计	60,996.94

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
审计费用	17,701.53
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	400.00
银行间账户维护费	3,000.00
合计	21,101.53

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	279,235.12
其中：支付销售机构的客户维护费	73,264.31

注：1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	93,078.37

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售	本期

服务费的各关联方名称	2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘安康颐利混合A	天弘安康颐利混合C	合计
天弘基金管理有限公司	-	28,790.68	28,790.68
合计	-	28,790.68	28,790.68

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。天弘安康颐利混合C按0.20%计提销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘安康颐利混合A不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年04月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	2,341,697.41	122,372.76

注：本基金由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管的银行存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2022年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额8,748,403.01元，于2022年07月01日、2022年07月04日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为主动投资的混合型基金，其风险收益预期高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及短期金融工具等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取在严格控制风险的前提下，谋求实现基金财产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	32,211,901.37
合计	32,211,901.37

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	29,395,211.26
合计	29,395,211.26

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日
AAA	8,710,014.20
AAA以下	14,233,685.42
未评级	-
合计	22,943,699.62

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此

外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2022年06月30日，除卖出回购金融资产款余额中有8,748,403.01元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。本期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风

险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,341,697.41	-	-	-	2,341,697.41
结算备付金	83,737,529.90	-	-	-	83,737,529.90
存出保证金	143,431.37	-	-	-	143,431.37
交易性金融资产	61,607,112.63	20,755,278.19	2,188,421.43	36,634,294.99	121,185,107.24
应收股利	-	-	-	748.00	748.00
应收申购款	-	-	-	34,536.74	34,536.74
资产总计	147,829,771.31	20,755,278.19	2,188,421.43	36,669,579.73	207,443,050.66
负债					
卖出回购金融资产款	8,748,403.01	-	-	-	8,748,403.01
应付清算款	-	-	-	870,874.91	870,874.91
应付赎回款	-	-	-	490,781.48	490,781.48
应付管理人报酬	-	-	-	98,625.46	98,625.46
应付托管费	-	-	-	32,875.15	32,875.15
应付销售服务费	-	-	-	14,526.77	14,526.77
应交税费	-	-	-	216.37	216.37
其他负债	-	-	-	57,740.03	57,740.03

负债总计	8,748,403.01	-	-	1,565,640.17	10,314,043.18
利率敏感度缺口	139,081,368.30	20,755,278.19	2,188,421.43	35,103,939.56	197,129,007.48

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2022年06月30日
	市场利率下降25个基点	335,804.71
	市场利率上升25个基点	-332,659.76

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,548,576.34	-	1,548,576.34
应收股利	-	748.00	-	748.00
资产合计	-	1,549,324.34	-	1,549,324.34
以外币计价的负债				

负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,549,324.34	-	1,549,324.34

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2022年06月30日
	所有外币相对人民币升值 5%	77,466.22
	所有外币相对人民币贬值 5%	-77,466.22

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的0-30%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	36,634,294.99	18.58
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	36,634,294.99	18.58

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2022年06月30日，本基金持有的交易性权益类投资占基金资产净值的比例为18.58%，因此其他价格风险对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日
第一层次	59,577,994.61
第二层次	61,607,112.63

第三层次	-
合计	121,185,107.24

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	36,634,294.99	17.66
	其中：股票	36,634,294.99	17.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	84,550,812.25	40.76
	其中：债券	84,550,812.25	40.76
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	86,079,227.31	41.50
8	其他各项资产	178,716.11	0.09
9	合计	207,443,050.66	100.00

注：本报告期末，本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为1,548,576.34元，占基金资产净值的比例为0.79%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	829,050.00	0.42
B	采矿业	5,228,151.00	2.65
C	制造业	17,218,834.45	8.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,932,514.00	1.99
E	建筑业	1,152,844.00	0.58
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,402,893.00	1.73
K	房地产业	2,400,584.00	1.22
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	492,583.20	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	428,265.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	35,085,718.65	17.80

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
基础材料	-	-
非日常生活消费品	31,086.16	0.02
日常消费品	-	-
能源	35,439.07	0.02
金融	198,062.00	0.10
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	1,071,833.57	0.54
电信服务	212,155.54	0.11
公用事业	-	-
地产业	-	-
合计	1,548,576.34	0.79

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601088	中国神华	81,200	2,703,960.00	1.37
2	600104	上汽集团	143,900	2,562,859.00	1.30

3	600461	洪城环境	246,300	1,992,567.00	1.01
4	601899	紫金矿业	182,700	1,704,591.00	0.86
5	600496	精工钢构	342,600	1,582,812.00	0.80
6	001979	招商蛇口	103,800	1,394,034.00	0.71
7	002984	森麒麟	40,400	1,256,844.00	0.64
8	601668	XD中国建	216,700	1,152,844.00	0.58
9	600905	三峡能源	175,900	1,106,411.00	0.56
10	000902	新洋丰	65,200	1,101,228.00	0.56
11	601166	兴业银行	52,900	1,052,710.00	0.53
12	601012	隆基绿能	15,440	1,028,767.20	0.52
13	002398	垒知集团	159,100	1,021,422.00	0.52
14	002475	立讯精密	29,800	1,006,942.00	0.51
15	000002	万科A	49,100	1,006,550.00	0.51
16	000776	广发证券	50,400	942,480.00	0.48
17	600011	华能国际	118,400	833,536.00	0.42
18	002714	牧原股份	15,000	829,050.00	0.42
19	000786	北新建材	23,500	813,570.00	0.41
20	300122	智飞生物	6,900	765,969.00	0.39
21	300059	东方财富	28,400	721,360.00	0.37
22	601318	中国平安	14,700	686,343.00	0.35
23	600887	伊利股份	15,300	595,935.00	0.30
24	000729	燕京啤酒	61,100	590,226.00	0.30
25	601225	陕西煤业	27,500	582,450.00	0.30
26	600808	马钢股份	147,600	559,404.00	0.28
27	000301	东方盛虹	32,500	549,575.00	0.28
28	00696	中国民航信息网 络	40,000	521,323.82	0.26
29	600031	三一重工	26,200	499,372.00	0.25
30	002371	北方华创	1,800	498,816.00	0.25
31	300416	苏试试验	20,040	492,583.20	0.25
32	603799	华友钴业	4,600	439,852.00	0.22

33	300144	宋城演艺	27,900	428,265.00	0.22
34	002049	紫光国微	2,100	398,412.00	0.20
35	300709	精研科技	13,320	394,138.80	0.20
36	000420	吉林化纤	78,800	375,876.00	0.19
37	01810	小米集团-W	31,200	363,941.50	0.18
38	600760	中航沈飞	5,100	308,295.00	0.16
39	600660	福耀玻璃	6,800	284,308.00	0.14
40	600256	广汇能源	22,500	237,150.00	0.12
41	00700	腾讯控股	700	212,155.54	0.11
42	300088	长信科技	28,000	207,760.00	0.11
43	00388	香港交易所	600	198,062.00	0.10
44	00981	中芯国际	12,000	186,568.25	0.09
45	000739	普洛药业	7,200	148,608.00	0.08
46	002594	比亚迪	200	66,698.00	0.03
47	002545	东方铁塔	5,400	61,452.00	0.03
48	002171	楚江新材	6,300	58,779.00	0.03
49	601089	N福元	1,749	36,816.45	0.02
50	00883	中国海洋石油	4,000	35,439.07	0.02
51	02331	李宁	500	31,086.16	0.02
52	603668	天马科技	200	4,098.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601088	中国神华	2,652,107.98	1.35
2	600104	上汽集团	2,476,487.99	1.26
3	600461	洪城环境	1,966,366.00	1.00
4	601899	紫金矿业	1,766,735.00	0.90
5	600496	精工钢构	1,537,540.00	0.78

6	002984	森麒麟	1,302,861.00	0.66
7	001979	招商蛇口	1,284,829.00	0.65
8	601668	中国建筑	1,187,809.00	0.60
9	601012	隆基绿能	1,106,945.40	0.56
10	000902	新洋丰	1,088,970.00	0.55
11	600905	三峡能源	1,079,347.00	0.55
12	600887	伊利股份	1,050,737.00	0.53
13	002398	垒知集团	1,041,175.00	0.53
14	601166	兴业银行	1,031,916.00	0.52
15	002475	立讯精密	1,031,793.00	0.52
16	000776	广发证券	999,169.00	0.51
17	000002	万科A	929,787.00	0.47
18	600309	万华化学	887,910.00	0.45
19	600011	华能国际	823,892.00	0.42
20	002714	牧原股份	798,778.00	0.41

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600309	万华化学	957,147.00	0.49
2	601857	中国石油	766,038.00	0.39
3	601066	中信建投	710,935.00	0.36
4	605007	五洲特纸	709,291.00	0.36
5	600887	伊利股份	489,042.00	0.25
6	603678	火炬电子	448,140.00	0.23
7	600438	通威股份	364,301.00	0.18
8	00857	中国石油 股份	318,254.43	0.16

9	601012	隆基绿能	290,392.19	0.15
10	603668	天马科技	212,370.00	0.11
11	002475	立讯精密	136,274.00	0.07
12	002984	森麒麟	136,079.00	0.07
13	603799	华友钴业	110,309.00	0.06
14	002025	航天电器	96,743.00	0.05

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	40,743,491.16
卖出股票收入（成交）总额	5,745,315.62

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	32,211,901.37	16.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	22,943,699.62	11.64
8	同业存单	29,395,211.26	14.91
9	其他	-	-
10	合计	84,550,812.25	42.89

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112205078	22建设银行CD 078	300,000	29,395,211.2 6	14.91
2	019674	22国债09	200,000	20,077,221.9 2	10.18
3	019666	22国债01	120,000	12,134,679.4 5	6.16
4	110059	浦发转债	60,000	6,359,926.03	3.23
5	110073	国投转债	15,000	1,604,997.53	0.81

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【上海浦东发展银行股份有限公司】分别于2021年07月13日、2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【中国建设银行股份有限公司】于2021年08月13日收到中国人民银行出具公开

处罚、公开批评的通报，于2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	143,431.37
2	应收清算款	-
3	应收股利	748.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	34,536.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	178,716.11

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	6,359,926.03	3.23
2	110073	国投转债	1,604,997.53	0.81
3	123049	维尔转债	1,432,051.15	0.73
4	123090	三诺转债	1,207,904.11	0.61
5	123004	铁汉转债	1,144,373.70	0.58
6	113569	科达转债	1,060,798.63	0.54
7	123113	仙乐转债	990,864.00	0.50
8	123128	首华转债	949,582.11	0.48
9	128063	未来转债	942,781.37	0.48
10	113623	凤21转债	917,776.44	0.47

11	113593	沪工转债	814,555.10	0.41
12	127033	中装转2	694,219.73	0.35
13	123132	回盛转债	604,609.18	0.31
14	113598	法兰转债	590,164.64	0.30
15	113530	大丰转债	584,928.08	0.30
16	128138	侨银转债	580,336.03	0.29
17	113605	大参转债	554,629.56	0.28
18	110062	烽火转债	544,212.33	0.28
19	128127	文科转债	331,656.99	0.17
20	123107	温氏转债	200,878.31	0.10
21	113542	好客转债	198,224.46	0.10

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
天弘 安康 颐利 混合A	2,493	44,110.35	4,999,208.33	4.55%	104,967,901.99	95.45%
天弘 安康	1,113	76,021.56	60,005,000.00	70.92%	24,606,997.25	29.08%

颐利混合C						
合计	3,559	54,672.41	65,004,208.33	33.41%	129,574,899.24	66.59%

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天弘安康颐利混合A	261,808.37	0.24%
	天弘安康颐利混合C	5,000.46	0.01%
	合计	266,808.83	0.14%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	天弘安康颐利混合A	0
	天弘安康颐利混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘安康颐利混合A	10~50
	天弘安康颐利混合C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘安康颐利混合A	天弘安康颐利混合C
基金合同生效日(2022年04月15日)基金份额总额	124,879,298.43	129,411,610.16
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,260,970.66	1,503,369.88
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	16,173,158.77	46,302,982.79
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	109,967,110.32	84,611,997.25

注:本基金合同于2022年04月15日生效。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内,本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内,无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
大同证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	11,924,820.88	25.67%	8,776.28	24.40%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	1,999,934.00	4.30%	1,462.47	4.07%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	9,193,567.09	19.79%	8,583.06	23.87%	-
华泰证券	1	6,412,769.00	13.80%	4,689.58	13.04%	-
华西证券	1	2,306,629.07	4.96%	1,686.85	4.69%	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	10,076,928.36	21.69%	7,438.84	20.68%	-
招商	2	-	-	-	-	-

浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	4,548,588.00	9.79%	3,326.39	9.25%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
大同证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	1,167,189.30	1.42%	295,044,000.00	16.89%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	98,074.83	0.12%	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	62,877,521.40	76.61%	1,439,533,000.00	82.40%	-	-	-	-
华泰证券	6,331,964.87	7.72%	-	-	-	-	-	-
华西证券	2,379,432.99	2.90%	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-

兴业证券	1,874,269.90	2.28%	12,381,000.00	0.71%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	7,343,957.86	8.95%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-01-04
2	天弘安康颐利混合型证券投资基金产品资料概要	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-01-11
3	天弘安康颐利混合型证券投资基金托管协议	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-01-11
4	天弘安康颐利混合型证券投资基金基金合同	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-01-11
5	天弘安康颐利混合型证券投资基金招募说明书	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-01-11
6	天弘安康颐利混合型证券投资基金基金份额发售公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-01-11
7	天弘安康颐利混合型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-04-16
8	天弘安康颐利混合型证券投资基金产品资料概要(更新)	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-04-18
9	天弘基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-04-22
10	天弘基金管理有限公司关于设立浙江分公司公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-04-26
11	天弘基金管理有限公司关于注销天津理财中心的公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-05-06

12	天弘基金管理有限公司关于天弘安康颐利混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	证券时报、中国证监会指定媒介	2022-05-12
----	---	----------------	------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7号）、《企业会计准则第23号—金融资产转移》（财会〔2017〕8号）、《企业会计准则第24号—套期会计》（财会〔2017〕9号）、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（财会〔2017〕14号）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号）等相关规定，自2022年1月1日起，天弘基金管理有限公司旗下资产管理产品开始执行新金融工具相关会计准则。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘安康颐利混合型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘安康颐利混合型证券投资基金基金合同
- 3、天弘安康颐利混合型证券投资基金托管协议
- 4、天弘安康颐利混合型证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二二年八月三十一日