

天弘基金严选之平安红FOF十二期集合资产管理计划

2023年第1季度投资报告

2023年03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：二〇二三年四月二十八日

§ 1 投资组合概况

| | |
|--------------|--------------------------|
| 投资组合名称 | 天弘基金严选之平安红FOF十二期集合资产管理计划 |
| 资产管理计划成立日 | 2021年02月23日 |
| 报告期末投资组合资产总值 | 12,557,007.27元 |
| 报告期末投资组合份额总额 | 12,041,660.66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 (2023年01月01日 -2023年03月31日) |
|------------|-----------------------------------|
| 本期已实现收益 | 46,763.84 |
| 本期利润 | 329,623.83 |
| 期末投资组合资产净值 | 12,526,497.10 |

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 |
|----------|----------|-----------|--------|----|
| 2023年1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

债市方面,一季度利率先上后下,债券二级市场结构性行情显著。1月受疫情高峰已过,经济预期向好,以及股市上涨提振风险偏好等利空因素影响,利率上行;2月高频经济指标自中旬以后加速修复,但市场对经济预期摇摆,叠加股

市上涨动能走弱，长端国债窄幅震荡；3月，受两会政策低于预期，市场经济预期转弱，海外银行事件压制风险偏好等因素影响，利率普遍下行。股市方面，一季度市场依次经历了价值、成长和主题方向的估值修复过程，在AI等主题催化下TMT板块整体表现出较强的赚钱效应。

本产品固收部分配置仍以纯债基金为主，以风格稳健的绝对收益目标二级债基为辅。一季度权益基金配置比例没有变化，结构方面目前以均衡轮动风格、绝对收益策略的权益基金为主。

展望后市，对于今年的实体经济我们仍然认为是一个复苏的形势，但复苏的节奏会比较纠结。当前市场表现来看，投资者对经济复苏已经没有太高的预期，而弱经济现实对应弱预期反而很容易出现超预期的状况。事实上，政策的发力已经悄然开始，无论是超预期降准，还是消费基础设施REITs政策出台，都在传递积极信号，今年经济修复的底线目标还在。因此对于权益资产全年表现不应悲观，尤其是前期基于衰退逻辑演绎出现较大幅度调整的顺周期板块，后续会有向上修复的动力，同时科技板块作为全年产业主线，预计会围绕着人工智能主题反复表现，因此组合权益部分还是会以均衡型品种为主，兼顾经济复苏和科技成长两大方向。

3.1.4 报告期内投资组合的业绩表现

截至2023年03月31日，本投资组合份额净值为1.0403元，本报告期份额净值增长率2.01%。

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十二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十二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十二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十二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 | 项目 | 金额（元） | 占计划总资产的比例 |
|---|----|-------|-----------|
|---|----|-------|-----------|

| 号 | | | (%) |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 1 | 权益投资 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中：股票 | 0.00 | 0.00 |
| 2 | 资管产品投资 | 11,835,436.91 | 94.25 |
| 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 | 721,570.36 | 5.75 |
| 7 | 其他各项资产 | 0.00 | 0.00 |
| 8 | 合计 | 12,557,007.27 | 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 | 008383 | 招商安心收益债券A | 1,656,079.35 | 2,970,675.14 | 23.72 |
| 2 | 003863 | 招商招祥纯债A | 1,926,723.43 | 2,059,089.33 | 16.44 |
| 3 | 050027 | 博时信用债纯债债券A | 1,824,066.87 | 2,037,482.69 | 16.27 |
| 4 | 008792 | 招商安华债券C | 1,363,359.40 | 1,539,369.10 | 12.29 |
| 5 | 003949 | 兴全稳泰债券A | 1,033,823.89 | 1,150,852.75 | 9.19 |
| 6 | 217022 | 招商产业债券A | 312,406.46 | 528,904.14 | 4.22 |
| 7 | 010761 | 华商甄选回报混合A | 179,273.40 | 250,624.21 | 2.00 |
| 8 | 000979 | 景顺长城沪港深精选股票 | 116,967.18 | 216,740.18 | 1.73 |
| 9 | 006195 | 国金量化多因子股票A | 55,023.14 | 112,450.79 | 0.90 |
| 10 | 007110 | 国投瑞银港股通价值发现混合A | 110,547.72 | 102,234.53 | 0.82 |

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及法规要求。

§ 7 涉及投资者权益的其他事项

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。

7.5 其他事项

本报告期内，未发生其他需要特别说明的事项。

§ 8 费用计提

8.1 管理费计提情况

本报告期内，本计划计提15,580.08元管理费。

8.2 托管费计提情况

本报告期内，本计划计提779.03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

本报告期内，本计划计提11,685.06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
二〇二三年四月二十八日