

# 天弘基金严选之平安红FOF五期集合资产管理计划

## 2022年第3季度投资报告

2022年09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：二〇二二年十月三十一日

## § 1 投资组合概况

投资组合名称	天弘基金严选之平安红FOF五期集合资产管理计划
资产管理计划成立日	2020年09月22日
报告期末投资组合资产总值	49,595,118.29元
报告期末投资组合份额总额	35,865,119.09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 (2022年07月01日 -2022年09月30日)
本期已实现收益	149,760.92
本期利润	-333,794.89
期末投资组合资产净值	36,059,112.71

### 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3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

三季度,利率先下后上,债券市场交易重心围绕“资金宽松”、“超预期降息”、“汇率贬值”展开。7月债券二级市场利率下行,走势相对平稳。进入8月,疫情、高温等因素影响下基本面不及预期催化债市行情,曲线呈现牛平走

势。9月，在通胀担忧叠加联储鹰派影响下人民币对美元汇率贬值，叠加月末房市政策等频出，长端利率进一步上行，债市下跌。A股市场三季度呈现震荡下跌和资金流出态势，受海内外宏观层面的利空和不稳定因素影响，市场情绪低迷，申万31个一级行业中除煤炭其余均收跌，市场赚钱效应不佳。

产品配置方面，固收部分配置以纯债基金为主，以风格稳健的绝对收益目标二级债基为辅；权益部分以均衡轮动风格、绝对收益策略的权益基金为主，穿透后的权益仓位在三季度基本保持稳定。

展望后市，随着国内外一些不确定性得到解除，预计市场情绪将出现比较积极的变化。以一个季度的维度来看，对债券保持多头思维，本轮经济周期见底可能要等到明年二季度，货币政策维持宽松必要性高，市场资产荒的格局大概率延续。综合考虑估值、交易、资金行为等信号，A股市场底部区间正在经历多信号验证的阶段，从中期维度看，考虑到股债吸引力等估值指标给出的信号，在回撤可控的前提下，适度逆向增配股票资产，谨慎把握后续市场机会。

### 3.1.4 报告期内投资组合的业绩表现

截至2022年09月30日，本投资组合份额净值为1.0054元，本报告期份额净值增长率-0.72%。

## 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五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五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五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五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	31,151,579.57	62.81

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	18,443,538.72		37.19
7	其他各项资产		0.00	0.00
8	合计	49,595,118.29		100.00

注：由于本计划开放，导致本报告期末资管产品投资比例被动超标，已在法规及资产管理合同规定的期限内调整达标。

#### 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	产品名称	持有份额(份)	公允价值(元)	占计划资产
----	-----	------	---------	---------	-------

	码				净值比例 (%)
1	008383	招商安心 收益债券A	1,511,971.23	2,696,903.08	7.48
2	007616	富国投资 级信用债 债券A	2,070,038.75	2,160,706.45	5.99
3	100058	富国产业 债债券A	1,794,918.29	2,135,414.29	5.92
4	003327	万家鑫璟 纯债债券A	1,721,857.59	2,058,997.31	5.71
5	519782	交银裕隆 纯债债券A	1,581,929.09	2,055,558.66	5.70
6	002169	永赢稳益 债券	1,845,145.98	2,027,815.43	5.62
7	519718	交银纯债 债券发起 A/B	1,849,071.09	2,021,774.33	5.61
8	003280	鹏华丰恒 债券	1,809,174.48	2,005,650.83	5.56
9	160622	鹏华丰利 债券(LOF)	1,892,627.01	1,913,445.91	5.31
10	110008	易方达稳 健收益债 券B	1,387,840.81	1,896,623.25	5.26

#### 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，本计划投资投资顾问管理的资管产品如下：

序号	产品代码	产品名称	本报告期买入份额（份）	本报告期末持有份额（份）
1	A04883	平安资产创赢150号资产管理产品	913,492.28	913,492.28

### § 8 费用计提

#### 8.1 管理费计提情况

本报告期，本计划计提49,707.39元管理费。

#### **8.2 托管费计提情况**

本报告期，本计划计提2,485.39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37,280.58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  
二〇二二年十月三十一日