

# 天弘安康颐 and 混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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:上海银行股份有限公司

送出日期:2021 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年08月27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2021年01月01日起至2021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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
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	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	56
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59

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.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
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.....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘安康颐 and 混合型证券投资基金	
基金简称	天弘安康颐 and	
基金主代码	010043	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年12月02日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	253,007,076.32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 and A	天弘安康颐 and C
下属分级基金的交易代码	010043	010044
报告期末下属分级基金的份额总额	190,767,320.73份	62,239,755.59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	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、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×85%+沪深300指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 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	上海银行股份有限公司
信息披 姓名	童建林	周直毅

露负责人	联系电话	022-83310208	021-68475608
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	custody@bosscn.com
客户服务电话		95046	95594
传真		022-83865569	021-68476936
注册地址		天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号42层
邮政编码		300203	200120
法定代表人		胡晓明	金煜

注：在本报告截止日至报告批准送出日之间，法定住所变更为：天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层；法定代表人变更为：韩歆毅。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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的办公地址

## 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
---------------	-----

	(2021年01月01日-2021年06月30日)	
	天弘安康颐和A	天弘安康颐和C
本期已实现收益	8,735,582.94	3,049,966.15
本期利润	10,740,484.19	3,115,229.72
加权平均基金份额本期利润	0.0595	0.0433
本期加权平均净值利润率	5.81%	4.25%
本期基金份额净值增长率	5.48%	5.38%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	9,260,454.10	2,945,790.00
期末可供分配基金份额利润	0.0485	0.0473
期末基金资产净值	202,686,992.15	66,052,350.84
期末基金份额净值	1.0625	1.0613
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	6.25%	6.13%

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

天弘安康颐和A

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	1.27%	0.33%	-0.15%	0.13%	1.42%	0.20%
过去三个月	4.81%	0.31%	1.67%	0.15%	3.14%	0.16%
过去六个月	5.48%	0.37%	2.13%	0.21%	3.35%	0.16%
自基金合同生效日起至至今	6.25%	0.34%	3.29%	0.20%	2.96%	0.14%

天弘安康颐和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	1.26%	0.33%	-0.15%	0.13%	1.41%	0.20%
过去三个月	4.76%	0.31%	1.67%	0.15%	3.09%	0.16%
过去六个月	5.38%	0.37%	2.13%	0.21%	3.25%	0.16%
自基金合同生效日起至至今	6.13%	0.34%	3.29%	0.20%	2.84%	0.14%

### 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



天弘安康颐和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

(2020年12月02日-2021年06月30日)



天弘安康颐和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

(2020年12月02日-2021年06月30日)



注：1、本基金合同于2020年12月02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2020年12月02日至2021年06月01日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

## § 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、天津、深圳、四川设有分公司。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2021年6月30日，本基金管理人共管理117只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘文化新兴产业股票型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康颐养混合型证券投资基金、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金（LOF）、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘医疗健康混合型证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数增强型证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金、

天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘优选债券型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘悦享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金、天弘港股通精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘增强回报债券型证券投资基金、天弘安益债券型证券投资基金、天弘华享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘弘择短债债券型证券投资基金、天弘信益债券型证券投资基金、天弘养老目标日期2035三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘弘新混合型发起式证券投资基金、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金、天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）、天弘优质成长企业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘鑫利三年定期开放债券型证券投资基金、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金、天弘季季兴三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金、天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金、天弘越南市场股票型发起式证券投资基金（QDII）、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘增利短债债券型发起式证券投资基金、天弘恒享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘纯享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中债1-3年国开行债券指数发起式证券投资基金、天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、天弘鑫意39个月定期开放债券型证券投资基金、天弘兴享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中证中美互联网指数型发起式证券投资基金（QDII）、天弘中债3-5年政策性金融债指数发起式证券投资基金、天弘成享一年定期开放债券型证券投资基金、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金、天弘永裕平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘甄选食品饮料股票型发起式证券投资基金、天弘创新领航混合型证券投资基金、天弘聚新三个月定期开放混合型证券投资基金、天弘荣创一年持有期混合型证券投资基金、天弘智荟6个月持有期债券型证券投资基金、天弘中证科技100指数增强型发起式证券投资基金、天弘多元收益债券型证券投资基金、天弘多利一年定期开放混合型证券投资基金、天弘安利短债债券型证券投资基金、天弘安康颐和混合型证券投资基金、天弘合益债券型发起式证券投资基金、天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金、天弘国证消费100指数增强型发起式证券投资基金、天弘医药创新混合型证券投资基金、天弘睿新三个月定期开放混合型证券投资基金、天弘庆享债券型发起式证券投资基金、天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金、天弘中证农业主题指数型发起式证券投资基金、天弘国证生物医药指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指证券公司交易型开放

式指数证券投资基金、天弘中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、天弘创新成长混合型发起式证券投资基金、天弘国证A50指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、天弘益新混合型证券投资基金、天弘招添利混合型发起式证券投资基金、天弘消费股票型发起式证券投资基金、天弘中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金、天弘中债1-5年政策性金融债指数发起式证券投资基金、天弘先进制造混合型证券投资基金、天弘创业板300指数型发起式证券投资基金、天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金、天弘安怡30天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、天弘安盈一年持有期债券型发起式证券投资基金、天弘京津冀主题债券型发起式证券投资基金、天弘中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘兴益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金、天弘国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证全指医疗保健设备与服务指数型发起式证券投资基金。

#### 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	固定收益机构投资部总经理、固定收益部总经理、宏观研究部总经理、基金经理	2020年12月	-	12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	基金经理	2020年12月	-	14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。
赵鼎龙	基金经理助理	2020年12	-	6年	男，电子学硕士。历任泰康资产管理有限责任公司

		月			固收交易员。2017年8月加盟本公司，历任固定收益机构投资部研究员、投资经理助理、基金经理助理。
--	--	---	--	--	--------------------------------------------------

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、本基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作，不具有独立决策职能。

3、在本报告截止日至报告批准送出日之间，本基金管理人增聘胡东先生为本基金基金经理助理。

4、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非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

本基金本报告期内不存在异常交易行为。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，未产生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，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

安康颐和于去年12月成立，成立时点对于可投权益的偏债类基金并不友好；从获取稳定收益的目标出发，一季度在债券仓位基本配置完成后，以配置银行等金融股和部分高股息股票作为主要仓位配置。整体来看，避开了一季度核心资产的下跌，但因为初期配置了部分转债品种，在一二月份转债市场的调整中有所回撤，在初步积累之后，二季度主要投资策略是持仓在大盘价值和大盘成长之间切换，在整体高估的情况下赚业绩能部分消化估值的品种钱，对今年的震荡走势采取逆向投资策略。安康颐和的纯债部分仓位不高，久期在1.5年以内，以获取票息和骑乘收益为主。考虑到今年市场波动较大，安康颐和配置了转债持仓作为权益部分的分散和对冲，主要是以中低价转股意愿较强的转债为主。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年06月30日，天弘安康颐和A基金份额净值为1.0625元，天弘安康颐和C基金份额净值为1.0613元。报告期内份额净值增长率天弘安康颐和A为5.48%，同期业绩比较基准增长率为2.13%；天弘安康颐和C为5.38%，同期业绩比较基准增长率为2.13%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年资金整体维持中性观点，主要原因是中国经济在一季度走过高点，后续可能相对外围欧美经济偏弱，去年为应对新冠疫情冲击杠杆上升较快，在中外增速相对差值缩小的情况下，很难在资金面上收紧；同时，大幅放松的可能也较低，市场并不缺钱，经济处于震荡区间。

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，但仍能获得正收益；股票市场难有系统性机会，转债也很难走出较大行情，考虑到目前转债只数较多，且转债相对正股，存在大量结构性的机会，通过控制整体转债持仓的仓位，自下而上精选个券，转债仍能获得明显超出纯债的收益。对于安康颐和的纯权益部分，作为组合风险暴露比较大的部分，我们以长期持有确定性较高流动性较好的优质中大盘股作为重点，主要获取业绩兑现带来的收益，同时考虑权益部分和转债正股之间的适当区分对冲风险。

下半年市场风险点主要关注高估抱团股的估值是否会压缩和美元与美国国债收益率的走势；超额收益可能来自科技股的投资及转债品种的个券机会。

21年市场波动较大，肩负投资者的信任，组合将更看重基本面和估值的匹配度，力争为投资者获取稳健收益。

#### 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。估值委员会由公司分管固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

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、基金会计、风险管理人员及内控合规人员组成。

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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

## 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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：天弘安康颐 and 混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,270,309.52	12,508,080.99
结算备付金		824,104.15	-
存出保证金		109,629.28	-
交易性金融资产	6.4.7.2	266,977,330.23	201,754,855.62
其中：股票投资		73,154,811.83	66,891,738.00
基金投资		-	-
债券投资		193,822,518.40	134,863,117.62
资产支持证券投资		-	-



贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,100,000.00	62,211,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,859,778.31	1,197,204.15
应收股利		-	-
应收申购款		502,723.27	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		276,643,874.76	277,671,140.76
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		3,000,000.00	-
应付证券清算款		2,768,681.31	10,979,144.41
应付赎回款		1,801,991.83	-
应付管理人报酬		133,890.30	125,863.68
应付托管费		44,630.11	41,954.56
应付销售服务费		10,795.83	14,402.52
应付交易费用	6.4.7.7	48,701.22	48,930.78
应交税费		4,240.27	1,001.93
应付利息		319.32	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	91,281.58	-
负债合计		7,904,531.77	11,211,297.88
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	253,007,076.32	264,549,150.50

未分配利润	6.4.7.10	15,732,266.67	1,910,692.38
所有者权益合计		268,739,342.99	266,459,842.88
负债和所有者权益总计		276,643,874.76	277,671,140.76

注：1. 报告截止日2021年06月30日，天弘安康颐 and 混合型证券投资基金A类基金份额净值1.0625元，天弘安康颐 and 混合型证券投资基金C类基金份额净值1.0613元；基金份额总额253,007,076.32份，其中天弘安康颐 and 混合型证券投资基金A类基金份额190,767,320.73份，天弘安康颐 and 混合型证券投资基金C类基金份额62,239,755.59份。

2. 本基金的合同生效日为2020年12月02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 and 混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年0 6月30日
<b>一、收入</b>		15,381,377.22
1. 利息收入		2,009,225.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	48,726.71
债券利息收入		1,803,843.57
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		156,655.51
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,188,604.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,079,304.99
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	4,423,213.95
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-

股利收益	6.4.7.16	686,085.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,070,164.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	113,381.98
<b>减：二、费用</b>		1,525,663.31
1. 管理人报酬		770,180.72
2. 托管费		256,726.93
3. 销售服务费		72,825.43
4. 交易费用	6.4.7.19	238,998.95
5. 利息支出		85,947.34
其中：卖出回购金融资产支出		85,947.34
6. 税金及附加		2,808.44
7. 其他费用	6.4.7.20	98,175.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		13,855,713.91
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		13,855,713.91

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘安康颐 and 混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	264,549,150.50	1,910,692.38	266,459,842.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,855,713.91	13,855,713.91
三、本期基金份额交	-11,542,074.18	-34,139.62	-11,576,213.80

易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	108,931,396.64	3,182,171.66	112,113,568.30
2. 基金赎回款	-120,473,470.82	-3,216,311.28	-123,689,782.10
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	253,007,076.32	15,732,266.67	268,739,342.99

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

天弘安康颐和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”)证监许可[2020]1675号《关于准予天弘安康颐和混合型证券投资基金注册的批复》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《天弘安康颐和混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,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264,477,773.84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(2020)第1027号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘安康颐和混合型证券投资基金基金合同》于2020年12月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为264,549,150.50份基金份额,其中认购资金利息折合71,376.66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,基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《天弘安康颐和混合型证券投资基金基金合同》和《天弘安康颐和混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据所收取认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用方式的差异,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基金份额，称为天弘安康颐 and 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、在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为天弘安康颐 and 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类基金份额和C类基金份额单独计算并公布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 and 混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行、上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、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、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具(银行存款、同业存单)、国债期货、股指期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%-30%。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，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。国债期货、股指期货、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。如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率 $\times$ 15%+中证全债指数收益率 $\times$ 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 and 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2021年度上半年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2021年06月30日的财务状况以及2021年度上半年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。

##### 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

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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。

##### 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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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 and 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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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 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。

#### 6.4.4.13 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[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]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。

(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。

(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 2021年06月30日
活期存款	4,270,309.52
定期存款	-
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	-
合计	4,270,309.52

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	72,936,964.73	73,154,811.83	217,847.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	170,452,235.49	173,584,518.40	3,132,282.91
	银行间市场	20,001,163.84	20,238,000.00	236,836.16
	合计	190,453,399.33	193,822,518.40	3,369,119.07
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		263,390,364.06	266,977,330.23	3,586,966.17

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,100,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,100,000.00	-

##### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	827.67
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	370.90
应收债券利息	1,858,530.34
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	49.40
合计	1,859,778.31

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	48,701.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	48,701.22

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.13
应付证券出借违约金	-
预提费用	91,280.45
合计	91,281.58

#### 6.4.7.9 实收基金

## 6.4.7.9.1 天弘安康颐 and A

金额单位：人民币元

项目 (天弘安康颐 and A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	173,727,869.67	173,727,869.67
本期申购	78,865,696.98	78,865,696.98
本期赎回(以“-”号填列)	-61,826,245.92	-61,826,245.92
本期末	190,767,320.73	190,767,320.73

## 6.4.7.9.2 天弘安康颐 and C

金额单位：人民币元

项目 (天弘安康颐 and C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	90,821,280.83	90,821,280.83
本期申购	30,065,699.66	30,065,699.66
本期赎回(以“-”号填列)	-58,647,224.90	-58,647,224.90
本期末	62,239,755.59	62,239,755.59

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

## 6.4.7.10.1 天弘安康颐 and A

单位：人民币元

项目 (天弘安康颐 and A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	268,131.52	996,126.03	1,264,257.55
本期利润	8,735,582.94	2,004,901.25	10,740,484.19
本期基金份额交易产生的变动数	256,739.64	-341,809.96	-85,070.32
其中：基金申购款	1,950,402.63	-46,518.69	1,903,883.94
基金赎回款	-1,693,662.99	-295,291.27	-1,988,954.26

本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,260,454.10	2,659,217.32	11,919,671.42

## 6.4.7.10.2 天弘安康颐和C

单位：人民币元

项目 (天弘安康颐和C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	125,759.51	520,675.32	646,434.83
本期利润	3,049,966.15	65,263.57	3,115,229.72
本期基金份额交易产生的变动数	-229,935.66	280,866.36	50,930.70
其中：基金申购款	936,711.41	341,576.31	1,278,287.72
基金赎回款	-1,166,647.07	-60,709.95	-1,227,357.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,945,790.00	866,805.25	3,812,595.25

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	20,939.69
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	27,259.87
其他	527.15
合计	48,726.71

## 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	84,597,113.07

减：卖出股票成本总额	78,517,808.08
买卖股票差价收入	6,079,304.99

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	4,423,213.95
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	4,423,213.95

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	106,498,607.42
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	101,261,487.68
减：应收利息总额	813,905.79
买卖债券差价收入	4,423,213.95

##### 6.4.7.13.3 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。

##### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。



**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 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。

**6.4.7.15.2 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。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	686,085.69
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	686,085.69

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	2,070,164.82
——股票投资	-762,878.90
——债券投资	2,833,043.72
——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	2,070,164.82
----	--------------

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	112,968.06
基金转换费收入	413.92
合计	113,381.98

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	238,998.95
银行间市场交易费用	-
合计	238,998.95

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,395.05
银行间账户维护费	9,000.00
合计	98,175.50

### 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
上海银行股份有限公司	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 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	770,180.72
其中：支付销售机构的客户维护费	204,347.13

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
	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	256,726.93

注:支付基金托管人上海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

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘安康颐和A	天弘安康颐和C	合计
天弘基金管理有限公司	-	19,277.87	19,277.87
合计	-	19,277.87	19,277.87

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。天弘安康颐和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、天弘安康颐和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**

天弘安康颐和A

份额单位：份

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	48,976,393.38
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	48,976,393.38
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	25.67%

天弘安康颐和C

份额单位：份

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-

报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-

注：1、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

2、报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自级别的份额总额计算。

#### 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

本基金本期末及上年度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 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	4,270,309.52	20,939.69

注：本基金由基金托管人上海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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末及上年度末无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的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（2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688601	力芯微	2021-06-18	2021-12-28	科创板打新限售	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-
688276	百克生物	2021-06-17	2021-12-27	科创板打新限售	36.35	79.48	1,689	61,395.15	134,241.72	-
688676	金盘科技	2021-03-02	2021-09-09	科创板打新限售	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-
688217	睿昂基因	2021-05-07	2021-11-17	科创板打新限售	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-
688117	圣诺生物	2021-05-26	2021-12-03	科创板打新限售	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688195	腾景科技	2021-03-18	2021-09-27	科创板打新限售	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	-

688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,345	51,496.20	51,496.20	-
688659	元琛科技	2021-03-24	2021-10-08	科创板打新限售	6.50	10.46	3,671	23,861.50	38,398.66	-
688092	爱科科技	2021-03-12	2021-09-22	科创板打新限售	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
688681	科汇股份	2021-06-04	2021-12-16	科创板打新限售	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。



#### 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2021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2021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3,000,000.00元，于2021年07月02日到期。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存放在本基金的托管人上海银行股份有限公司。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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	15,910,049.20	30,235,976.10

合计	15,910,049.20	30,235,976.10
----	---------------	---------------

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

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

#### 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	111,643,532.90	87,342,470.00
AAA以下	65,266,936.30	17,284,671.52
未评级	1,002,000.00	-
合计	177,912,469.20	104,627,141.52

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。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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2021年06月30日，除卖出回购金融资产款余额中有3,000,000.00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约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期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。

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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	4,270,309.52	-	-	-	4,270,309.52
结算备付金	824,104.15	-	-	-	824,104.15
存出保证金	109,629.28	-	-	-	109,629.28
交易性金融资产	16,912,049.20	147,692,651.30	29,217,817.90	73,154,811.83	266,977,330.23
买入返售金融资产	2,100,000.00	-	-	-	2,100,000.00
应收利息	-	-	-	1,859,778.31	1,859,778.31
应收申购款	-	-	-	502,723.27	502,723.27
资产总计	24,216,092.15	147,692,651.30	29,217,817.90	75,517,313.41	276,643,874.76
负债					
卖出回购金融资产款	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	2,768,681.3	2,768,681.3

				1	1
应付赎回款	-	-	-	1,801,991.83	1,801,991.83
应付管理人报酬	-	-	-	133,890.30	133,890.30
应付托管费	-	-	-	44,630.11	44,630.11
应付销售服务费	-	-	-	10,795.83	10,795.83
应付交易费用	-	-	-	48,701.22	48,701.22
应交税费	-	-	-	4,240.27	4,240.27
应付利息	-	-	-	319.32	319.32
其他负债	-	-	-	91,281.58	91,281.58
负债总计	3,000,000.00	-	-	4,904,531.77	7,904,531.77
利率敏感度缺口	21,216,092.15	147,692,651.30	29,217,817.90	70,612,781.64	268,739,342.99
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,508,080.99	-	-	-	12,508,080.99
交易性金融资产	30,235,976.10	98,082,759.62	6,544,381.90	66,891,738.00	201,754,855.62
买入返售金融资产	62,211,000.00	-	-	-	62,211,000.00
应收利息	-	-	-	1,197,204.15	1,197,204.15
资产总计	104,955,057.09	98,082,759.62	6,544,381.90	68,088,942.15	277,671,140.76
负债					
应付证券清算款	-	-	-	10,979,144.41	10,979,144.41
应付管理人报酬	-	-	-	125,863.68	125,863.68
应付托管费	-	-	-	41,954.56	41,954.56
应付销售服务费	-	-	-	14,402.52	14,402.52
应付交易费用	-	-	-	48,930.78	48,930.78
应交税费	-	-	-	1,001.93	1,001.93
负债总计	-	-	-	11,211,297.88	11,211,297.88
利率敏感度缺口	104,955,057.09	98,082,759.62	6,544,381.90	56,877,644.27	266,459,842.88

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,175,390.30	642,484.64
	市场利率上升25个基点	-1,162,641.98	-636,522.60

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 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,包括VaR(Value at Risk)指标等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 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	73,154,811.83	27.22	66,891,738.00	25.10
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	73,154,811.83	27.22	66,891,738.00	25.10

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	3,896,720.47	2,664,598.43
	业绩比较基准下降5%	-3,896,720.47	-2,664,598.43

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年06月30日，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中属于第一层次的余额为141,892,433.54元，属于第二层次的余额为125,084,896.69元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次91,588,879.52元，第二层次110,165,976.10元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021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(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 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	73,154,811.83	26.44
	其中：股票	73,154,811.83	26.44
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	193,822,518.40	70.06
	其中：债券	193,822,518.40	70.06
	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	2,100,000.00	0.76
	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	5,094,413.67	1.84
8	其他各项资产	2,472,130.86	0.89
9	合计	276,643,874.76	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	2,797,473.00	1.04
C	制造业	35,044,582.02	13.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,475,109.39	0.92
E	建筑业	2,349,034.44	0.87
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,512,942.00	0.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,857,360.00	0.69
J	金融业	19,681,430.70	7.32
K	房地产业	3,981,628.00	1.48
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,455,252.28	0.91
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	73,154,811.83	27.22

### 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	601398	工商银行	802,800	4,150,476.00	1.54
2	600048	保利地产	330,700	3,981,628.00	1.48
3	601818	光大银行	1,000,000	3,780,000.00	1.41
4	601166	兴业银行	176,900	3,635,295.00	1.35
5	600887	伊利股份	88,900	3,274,187.00	1.22
6	600176	中国巨石	186,766	2,896,740.66	1.08
7	600028	中国石化	641,400	2,796,504.00	1.04
8	002460	赣锋锂业	22,774	2,757,703.66	1.03
9	603601	再升科技	236,300	2,733,991.00	1.02
10	300059	东方财富	81,240	2,663,859.60	0.99
11	601688	华泰证券	164,500	2,599,100.00	0.97
12	601006	大秦铁路	364,700	2,399,726.00	0.89
13	601668	XD中国建	502,800	2,338,020.00	0.87
14	600519	贵州茅台	1,100	2,262,370.00	0.84
15	600104	上汽集团	100,900	2,216,773.00	0.82
16	603678	火炬电子	32,800	2,214,000.00	0.82
17	000786	北新建材	53,700	2,107,725.00	0.78
18	603806	福斯特	19,440	2,043,727.20	0.76
19	603259	药明康德	13,000	2,035,670.00	0.76
20	000333	美的集团	26,300	1,877,031.00	0.70
21	688188	柏楚电子	4,260	1,857,360.00	0.69
22	600674	川投能源	149,400	1,842,102.00	0.69

23	603801	志邦家居	55,880	1,785,924.80	0.66
24	600522	中天科技	130,200	1,302,000.00	0.48
25	002311	海大集团	14,700	1,199,520.00	0.45
26	600690	海尔智家	43,600	1,129,676.00	0.42
27	603899	晨光文具	12,700	1,073,912.00	0.40
28	601601	XD中国太	35,300	1,022,641.00	0.38
29	601318	中国平安	15,400	989,912.00	0.37
30	603501	XD韦尔股	2,700	869,400.00	0.32
31	601766	中国中车	140,000	851,200.00	0.32
32	300607	拓斯达	24,000	835,200.00	0.31
33	601211	国泰君安	46,700	800,438.00	0.30
34	600886	国投电力	64,300	617,923.00	0.23
35	688131	皓元医药	1,212	419,582.28	0.16
36	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.15
37	600521	华海药业	11,400	238,032.00	0.09
38	688161	N威高	1,652	175,194.60	0.07
39	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.06
40	688276	百克生物	1,689	134,241.72	0.05
41	600377	宁沪高速	11,600	113,216.00	0.04
42	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.02
43	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.02
44	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.02
45	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
46	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.02
47	688087	英科再生	2,345	51,496.20	0.02
48	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.01
49	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.01
50	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
51	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.01
52	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
53	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01

54	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
55	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
56	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
57	600030	中信证券	200	4,988.00	0.00
58	605011	N杭热	525	4,662.00	0.00
59	600900	长江电力	100	2,064.00	0.00
60	601899	紫金矿业	100	969.00	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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601818	XD光大银	4,166,471.00	1.56
2	603806	福斯特	3,692,275.00	1.39
3	600028	中国石化	3,608,660.00	1.35
4	000333	美的集团	3,606,068.55	1.35
5	600176	中国巨石	3,132,241.00	1.18
6	002460	赣锋锂业	3,105,771.56	1.17
7	603259	药明康德	3,003,847.00	1.13
8	300059	东方财富	2,875,824.00	1.08
9	603601	再升科技	2,785,462.00	1.05
10	601899	紫金矿业	2,668,505.00	1.00
11	000786	北新建材	2,437,905.00	0.91
12	300415	伊之密	2,363,660.00	0.89
13	600104	上汽集团	2,326,846.00	0.87
14	600519	贵州茅台	2,286,989.00	0.86
15	600690	海尔智家	2,048,705.00	0.77
16	000651	格力电器	1,991,400.00	0.75
17	603801	志邦家居	1,978,264.00	0.74
18	603678	火炬电子	1,969,027.00	0.74

19	600760	中航沈飞	1,819,180.00	0.68
20	002557	洽洽食品	1,787,008.80	0.67

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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	601006	大秦铁路	6,501,495.00	2.44
2	601398	工商银行	5,471,419.00	2.05
3	600028	中国石化	4,597,725.00	1.73
4	600377	宁沪高速	4,043,864.00	1.52
5	601899	紫金矿业	3,829,686.00	1.44
6	601818	XD光大银	3,539,040.00	1.33
7	601939	建设银行	3,538,862.00	1.33
8	000333	美的集团	2,887,558.00	1.08
9	603806	福斯特	2,773,292.00	1.04
10	000002	万科A	2,549,925.30	0.96
11	601088	中国神华	2,484,219.00	0.93
12	300415	伊之密	2,415,571.00	0.91
13	002833	弘亚数控	2,353,098.00	0.88
14	000651	格力电器	1,860,102.00	0.70
15	600674	川投能源	1,836,131.00	0.69
16	603259	药明康德	1,731,611.60	0.65
17	000001	平安银行	1,647,745.00	0.62
18	600690	海尔智家	1,584,245.00	0.59
19	002557	洽洽食品	1,517,867.18	0.57
20	601601	中国太保	1,457,459.00	0.55

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	85,543,760.81
卖出股票收入（成交）总额	84,597,113.07

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	16,912,049.20	6.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,238,000.00	7.53
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	80,212,000.00	29.85
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	76,460,469.20	28.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	193,822,518.40	72.12

注：可转债项下包含可交换债6,947,887.50元。

## 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	2028054	20华夏银行	200,000	20,238,000.00	7.53
2	175534	20华泰G8	200,000	20,154,000.00	7.50
3	149326	20国信04	200,000	20,144,000.00	7.50
4	149353	21侨城03	200,000	20,076,000.00	7.47
5	163420	20光明01	200,000	19,838,000.00	7.38

**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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

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**

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，【华泰证券股份有限公司】于2020年11月23日收到中国证券监督管理委员会江苏监管局出具警示函的通报；【华夏银行股份有限公司】于2020年07月13日收到中国银行保险监督管理委员会出具罚款处罚的通报，于2021年05月17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	109,629.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,859,778.31
5	应收申购款	502,723.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-



8	其他	-
9	合计	2,472,130.86

## 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	128023	亚太转债	8,541,006.04	3.18
2	128037	岩土转债	8,372,664.48	3.12
3	132015	18中油EB	6,947,887.50	2.59
4	113017	吉视转债	6,459,515.40	2.40
5	123063	大禹转债	4,377,240.00	1.63
6	110072	广汇转债	4,259,941.20	1.59
7	110073	国投转债	3,678,296.50	1.37
8	128018	时达转债	3,160,259.70	1.18
9	113033	利群转债	2,323,638.00	0.86
10	113582	火炬转债	2,159,884.00	0.80
11	113565	宏辉转债	2,100,159.20	0.78
12	123078	飞凯转债	1,813,333.50	0.67
13	128119	龙大转债	1,472,426.00	0.55
14	123073	同和转债	1,447,706.40	0.54
15	123056	雪榕转债	1,293,000.00	0.48
16	128133	奇正转债	1,210,109.70	0.45
17	110048	福能转债	854,912.00	0.32
18	113535	大业转债	845,370.00	0.31
19	113610	灵康转债	817,654.60	0.30
20	128138	侨银转债	704,175.00	0.26
21	110051	中天转债	574,150.00	0.21
22	123010	博世转债	571,139.10	0.21
23	128063	未来转债	547,577.80	0.20
24	127018	本钢转债	525,420.00	0.20

25	128046	利尔转债	523,918.40	0.19
26	128015	久其转债	509,989.15	0.19
27	110064	建工转债	325,776.00	0.12
28	113036	宁建转债	265,563.20	0.10
29	123033	金力转债	260,940.00	0.10
30	128122	兴森转债	189,341.27	0.07
31	123090	三诺转债	157,146.00	0.06
32	127021	特发转2	73,773.36	0.03
33	113578	全筑转债	57,518.70	0.02
34	128121	宏川转债	52,890.60	0.02
35	128057	博彦转债	23,400.40	0.01
36	113585	寿仙转债	1,410.80	0.00
37	128124	科华转债	1,051.00	0.00

#### 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 颐和A	2,047	93,193.61	88,566,026.76	46.43%	102,201,293.97	53.57%
天弘	7,70	8,078.89	21,113,727.74	33.9	41,126,027.85	66.08%

安康颐和C	4			2%		
合计	9,751	25,946.78	109,679,754.50	43.35%	143,327,321.82	56.65%

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	天弘安康颐和A	319,058.40	0.17%
	天弘安康颐和C	2,217,286.72	3.56%
	合计	2,536,345.12	1.00%

## 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	天弘安康颐和A	0
	天弘安康颐和C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘安康颐和A	0
	天弘安康颐和C	10~50
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘安康颐和A	天弘安康颐和C
基金合同生效日(2020年12月02日)基金份额总额	173,727,869.67	90,821,280.83

本报告期期初基金份额总额	173,727,869.67	90,821,280.83
本报告期基金总申购份额	78,865,696.98	30,065,699.66
减：本报告期基金总赎回份额	61,826,245.92	58,647,224.90
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	190,767,320.73	62,239,755.59

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

## § 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，经天弘基金管理有限公司股东会2021年第2次会议审议通过，胡晓明先生、屠剑威先生、黄浩先生和卢信群先生不再担任公司董事。韩歆毅先生、周志峰先生、祖国明先生和张杰先生担任公司董事。

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	
天风证券	2	164,199,589.22	100.00%	120,079.28	100.00%	-

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状况稳定；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等。

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
天风证券	210,465,828.49	100.00%	1,582,304,000.00	100.00%	-	-	-	-

#### 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终止深圳盈信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-01-01
2	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒介	2021-01-13

	旗下部分基金在富滇银行股份有限公司开通定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告		
3	关于注意防范冒用天弘创新相关名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-02-24
4	天弘基金管理有限公司关于天弘安康颐和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	中国证监会指定媒介	2021-03-01
5	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-03-04
6	天弘创新资产管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-04-07
7	天弘安康颐和混合型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2021-04-22
8	天弘基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-02
9	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-02
10	天弘基金管理有限公司关于增加中信建投期货有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-07

## § 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

在本报告截止日至报告批准送出日之间，根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》法律法规及各基金基金合同等法律文件的规定，本基金已于7月27日相应修订基金合同等法律文件，具体信息请参见基金管理人7月27日在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同等法律文件的公告》及更新的法律文件。

## § 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 and 混合型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘安康颐 and 混合型证券投资基金基金合同
- 3、天弘安康颐 and 混合型证券投资基金托管协议
- 4、天弘安康颐 and 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办公场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](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二一年八月三十一日