

# 天弘安康颐享 12 个月持有期混合型证券投资基金

## 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

送出日期:2025 年 03 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。本年度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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年03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。

本报告期自2024年01月01日起至2024年12月31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、基金净值表现及利润分配情况 .....                 | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 8  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....                       | 10 |
| §4 管理人报告 .....                                | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 11 |
| 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 .....                 | 14 |
| 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 .....             | 15 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 15 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....                 | 16 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 18 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 18 |
| 4.9 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 .....       | 18 |
| §5 托管人报告 .....                                | 18 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 18 |
| 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 ..... | 19 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....       | 19 |
| §6 审计报告 .....                                 | 19 |
| 6.1 审计报告基本信息 .....                            | 19 |
| 6.2 审计报告的基本内容 .....                           | 19 |
| §7 年度财务报表 .....                               | 22 |
| 7.1 资产负债表 .....                               | 22 |
| 7.2 利润表 .....                                 | 24 |
| 7.3 净资产变动表 .....                              | 25 |
| 7.4 报表附注 .....                                | 27 |
| §8 投资组合报告 .....                               | 62 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 62 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 62 |
| 8.3 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 .....       | 64 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 65 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 67 |
| 8.6 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 .....      | 67 |
| 8.7 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 .....   | 67 |
| 8.8 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 .....   | 67 |
| 8.9 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 .....      | 68 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                     | 68 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 68 |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                      | 68 |
| §9 基金份额持有人信息 .....                       | 69 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 69 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 70 |
| 9.3 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 .....   | 70 |
| §10 开放式基金份额变动 .....                      | 71 |
| §11 重大事件揭示 .....                         | 71 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 71 |
| 11.2 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 .....   | 71 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 72 |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                     | 72 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 72 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 72 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 72 |
| 11.8 其他重大事件 .....                        | 74 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 77 |
| 12.1 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 ..... | 77 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 77 |
| §13 备查文件目录 .....                         | 77 |
| 13.1 备查文件目录 .....                        | 77 |
| 13.2 存放地点 .....                          | 77 |
| 13.3 查阅方式 .....                          | 77 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                 |                        |                |
|-----------------|------------------------|----------------|
| 基金名称            | 天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金 |                |
| 基金简称            | 天弘安康颐享12个月持有           |                |
| 基金主代码           | 012069                 |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                 |                |
| 基金合同生效日         | 2021年06月08日            |                |
| 基金管理人           | 天弘基金管理有限公司             |                |
| 基金托管人           | 中国民生银行股份有限公司           |                |
| 报告期末基金份额总额      | 411,213,323.88份        |                |
| 基金合同存续期         | 不定期                    |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 天弘安康颐享12个月持有A          | 天弘安康颐享12个月持有C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 012069                 | 012070         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 381,751,730.17份        | 29,461,593.71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。                                               |
| 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。本基金将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                    | 中国民生银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 童建林                           | 林盛                 |
|         | 联系电话 | 022-83310208                  | 010-58560666       |
|         | 电子邮箱 | service@thfund.com.cn         | tgxxpl@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 95046                         | 95568              |
| 传真      |      | 022-83865564                  | 010-57093382       |
| 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23层 | 北京市西城区复兴门内大街2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   | 北京市西城区复兴门内大街2号     |
| 邮政编码    |      | 300203                        | 100031             |
| 法定代表人   |      | 黄辰立                           | 高迎欣                |

## 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              |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.thfund.com.cn |
| 基金年度报告备置地点          | 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                        |
|--------|--------------------|-----------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层     |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2024年          |               | 2023年          |               | 2022年            |               |
|---------------|----------------|---------------|----------------|---------------|------------------|---------------|
|               | 天弘安康颐享12个月持有A  | 天弘安康颐享12个月持有C | 天弘安康颐享12个月持有A  | 天弘安康颐享12个月持有C | 天弘安康颐享12个月持有A    | 天弘安康颐享12个月持有C |
| 本期已实现收益       | 9,524,812.84   | 575,246.42    | -39,153,379.04 | -2,516,662.75 | -70,178,620.78   | -4,607,711.06 |
| 本期利润          | 36,298,482.53  | 2,327,704.82  | 14,299,330.45  | 457,895.14    | -165,897,287.38  | -9,866,912.84 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0556         | 0.0509        | 0.0108         | 0.0060        | -0.0589          | -0.0618       |
| 本期加权平均净值利润率   | 5.50%          | 5.09%         | 1.08%          | 0.60%         | -5.81%           | -6.12%        |
| 本期基金份额净值增长率   | 6.05%          | 5.61%         | 0.38%          | -0.01%        | -5.58%           | -5.96%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2024年末         |               | 2023年末         |               | 2022年末           |               |
| 期末可供分配利润      | 3,300,695.73   | -167,645.50   | -12,751,540.17 | -1,391,652.60 | -22,101,355.90   | -1,859,278.63 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0086         | -0.0057       | -0.0134        | -0.0234       | -0.0123          | -0.0185       |
| 期末基金资产净值      | 401,428,025.36 | 30,535,745.45 | 941,811,704.82 | 58,272,036.21 | 1,775,336,955.93 | 98,698,143.42 |
| 期末基金份额净值      | 1.0515         | 1.0365        | 0.9915         | 0.9814        | 0.9877           | 0.9815        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2024年末         |               | 2023年末         |               | 2022年末           |               |
| 基金份额累计净值增长率   | 6.17%          | 4.66%         | 0.11%          | -0.91%        | -0.27%           | -0.90%        |

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

天弘安康颐享12个月持有A

| 阶段                  | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③     | ②-④   |
|---------------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|---------|-------|
| 过去三个月               | 1.52%        | 0.34%               | 2.37%              | 0.25%                     | -0.85%  | 0.09% |
| 过去六个月               | 3.33%        | 0.28%               | 5.94%              | 0.23%                     | -2.61%  | 0.05% |
| 过去一年                | 6.05%        | 0.21%               | 10.12%             | 0.19%                     | -4.07%  | 0.02% |
| 过去三年                | 0.52%        | 0.25%               | 12.94%             | 0.17%                     | -12.42% | 0.08% |
| 自基金合同<br>生效日起至<br>今 | 6.17%        | 0.25%               | 14.97%             | 0.17%                     | -8.80%  | 0.08% |

天弘安康颐享12个月持有C

| 阶段                  | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③     | ②-④   |
|---------------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|---------|-------|
| 过去三个月               | 1.42%        | 0.34%               | 2.37%              | 0.25%                     | -0.95%  | 0.09% |
| 过去六个月               | 3.11%        | 0.27%               | 5.94%              | 0.23%                     | -2.83%  | 0.04% |
| 过去一年                | 5.61%        | 0.21%               | 10.12%             | 0.19%                     | -4.51%  | 0.02% |
| 过去三年                | -0.69%       | 0.25%               | 12.94%             | 0.17%                     | -13.63% | 0.08% |
| 自基金合同<br>生效日起至<br>今 | 4.66%        | 0.25%               | 14.97%             | 0.17%                     | -10.31% | 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

天弘安康颐享12个月持有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  
(2021年06月08日-2024年12月31日)



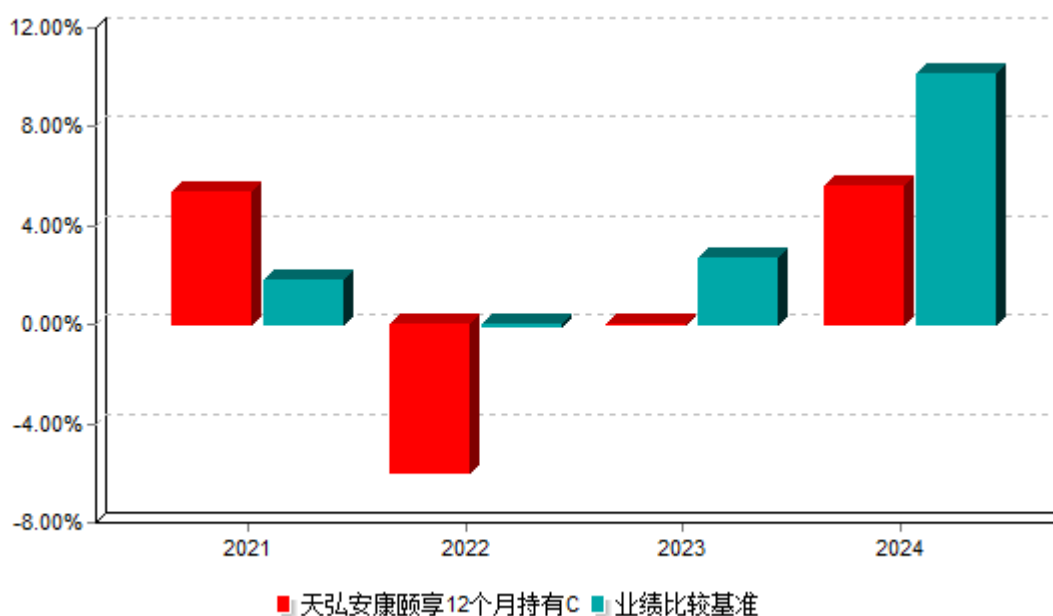
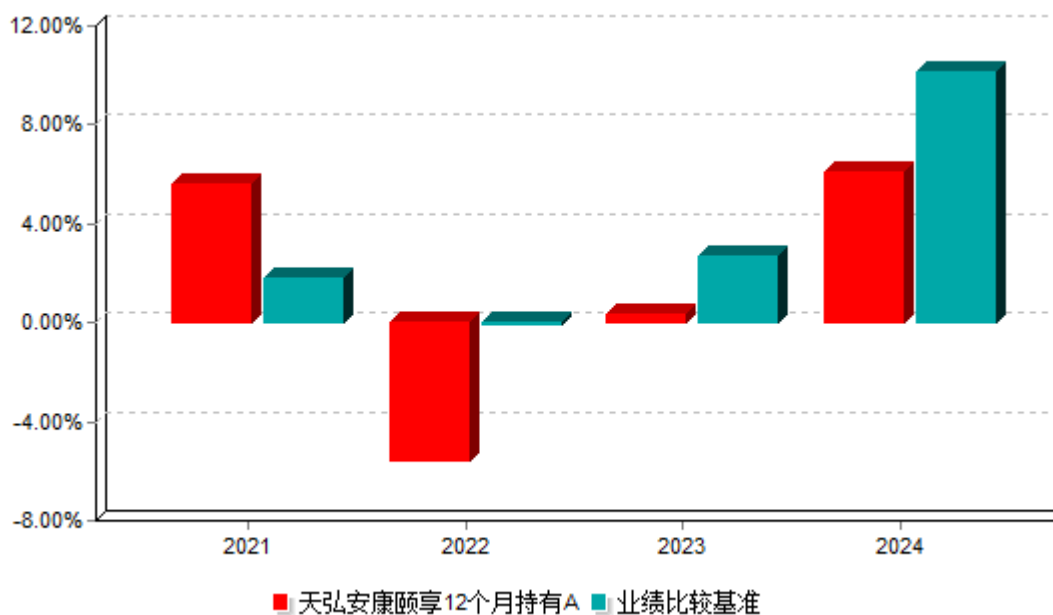
天弘安康颐享12个月持有C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年06月08日-2024年12月31日)



注：1、本基金合同于2021年06月08日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2021年06月08日生效。基金合同生效当年2021年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## §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2024年12月31日，公司共管理运作210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 |        |                                                                                                  |
| 胡彧 | 本基金基金经理 | 2023年07月        | -    | 14年    | 男，化学工程与技术专业硕士。历任UOP工艺技术国际公司北京代表处技术咨询代表；中信建投证券股份有限公司研究员；建信基金管理有限公司研究员；天弘基金管理有限公司研究员；安邦基金管理有限公司（筹） |

|     |                                     |          |          |     |                                                                                             |
|-----|-------------------------------------|----------|----------|-----|---------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                     |          |          |     | 研究部总经理；益民基金管理有限公司研究部总经理；中国民生信托有限公司研究部总经理，基金经理；明世伙伴基金管理（珠海）有限公司投资经理，研究总监。2022年12月加盟本公司。      |
| 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、混合资产部部门总经理 | 2021年06月 | -        | 15年 | 女，经济学硕士。历任本公司债券研究员、债券交易员、光大永明人寿保险有限公司债券研究员、债券交易员。2011年8月加盟本公司，历任固定收益研究员、基金经理助理、宏观研究部部门总经理等。 |
| 贺剑  | 本基金基金经理                             | 2021年06月 | 2024年04月 | 17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、投资经理，2020年5月加盟本公司，历任基金经理助理。                                   |
| 陈敏  | 本基金基金经理助理                           | 2024年10月 | -        | 9年  | 男，金融硕士。2015年7月加盟本公司，历任固定收益部债券研究员、固定收益研究部高级债券研究员、宏观研究部高级研究员。                                 |
| 胡东  | 本基金基金经理助理                           | 2024年08月 | -        | 7年  | 男，金融专业硕士，2017年7月加盟本公司，历任信用研究部信用研究员、固定收益部可转债研究员。                                             |
| 宛茹雪 | 本基金基金经理助理                           | 2024年03月 | -        | 7年  | 女，金融硕士。2017年7月加盟本公司，历任中央交易室债券交易员、高级债券交易员。                                                   |

|    |           |          |          |     |                                                                           |
|----|-----------|----------|----------|-----|---------------------------------------------------------------------------|
| 任明 | 本基金基金经理助理 | 2024年03月 | 2024年10月 | 12年 | 男，金融学硕士。2012年7月加盟本公司，历任公司固定收益部债券研究员、信用研究员、固定收益部总经理助理、信用研究部负责人、现金管理部副总经理。  |
| 徐凯 | 本基金基金经理助理 | 2024年01月 | 2024年08月 | 8年  | 男，金融专业硕士。历任中再资产管理股份有限公司评审与信用评级部研究员，2019年8月加盟本公司，历任固定收益机构投资部债券研究员。         |
| 胡东 | 本基金基金经理助理 | 2021年08月 | 2024年01月 | 7年  | 男，金融专业硕士，2017年7月加盟本公司，历任信用研究部信用研究员、固定收益部可转债研究员。                           |
| 彭玮 | 本基金基金经理助理 | 2021年06月 | 2024年03月 | 7年  | 男，金融专业硕士。历任渤海证券股份有限公司交易助理、渤海汇金证券资产管理有限公司投资经理助理。2019年7月加盟本公司，历任研究员、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。

3、在本报告截止日至报告批准送出日之间，本基金管理人宛茹雪女士不再担任本基金基金经理助理。

4、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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2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

年初以来，我们保持了相对稳定且偏中性的仓位水平；重点布局红利、上游和港股交运与互联网等稳定、现金流充沛或盈利周期坚实的资产；924政策转折下曾经短暂地将权益仓位提升至接近上限；我们保持了仓位稳重稍下行，并将持仓结构中弹性大、9月底超涨的品种切换成了成长性更佳或估值优势更显著的方向；配置的核心仍以港股互联网、消费、非银及确定性底部的制造业龙头为主，阶段性布局了半导体、新能源等具备一定进攻特性的方向与资产，在保持整体波动率可控的前提下，尝试捕捉市场节奏，力争增厚投资收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2024年12月31日，天弘安康颐享12个月持有A基金份额净值为1.0515元，天弘安康颐享12个月持有C基金份额净值为1.0365元。报告期内份额净值增长率天弘安康颐享12个月持有A为6.05%，同期业绩比较基准增长率为10.12%；天弘安康颐享12个月持有C为5.61%，同期业绩比较基准增长率为10.12%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在年终时点回顾全年，924将行情分为了清晰的两段：此前，市场的主要矛盾是经济压力的背景下，政策对于宏观经济和资本市场定力较强；923之后，政策的逆转彻底将投资者情绪从悲观中拉起，市场也回应以剧烈上涨与大量成交。但进入四季度，虽然政策依旧在延续与细化，包括地产、消费乃至制造业方面经济数据也逐渐呈现点状、阶段性好转，但市场反而陷入了2个多月的往复震荡，并未如乐观期待一般持续上行。

我们认为，这是市场的新旧主要矛盾青黄不接的体现：一方面，成功引导预期逆转后，政策端已经完成了阶段性使命，后续的政策会议虽然规格上或许更加重磅，但更多是在既有方向上的细化或延申，难以重现此前的逆转效应；另一方面，市场估值从底部被抬升至中位水平，后续单凭政策进一步推升，未免过于吃力；因此，新主要矛盾将落在政策的落地效果，亦即经济基本面或产业趋势的呈现上。但考虑到经济上行趋势的明朗、全面化需要时间，市场陷入了不断在轮动中寻找方向，却又迟迟无法明确主线的纠结中。

考虑到上述现状的成因在1-2个季度内预计不会有明显的逆转，即便市场提前反映2025景气修复或产业趋势的预期，预计未来短期内出现显著趋势的概率相对也会有限，

因此建议投资者在这个阶段保持一种“以可控成本参与市场、逐渐寻找和发现新主线”的投资策略。对于2025值得关注的布局的投资方向，我们认为可以从以下几个方向思考和观察：

红利作为具备弥补债券资产收益率下降效用的资产，在票息收益下行的趋势中或会成为一个重要选项；在绝对收益投资和固收+投资中可能会作为底仓吸引部分资金涌入；但一方面不同于2024上半年，红利作为权益资产中为数不多有正收益预期的方向对多种风格的权益资金都有吸引力，明年起，风险偏好积极的相对收益资金会尝试布局科技、消费甚至顺周期，红利共识度或会下降；此外，红利资产经历了一整年估值抬升，且部分行业的盈利&分红稳定性不如从前，因此吸引力预计不如2024年。

消费作为受到政策核心支持，以及受益于财富效应和居民预期逐渐改善的方向，同时也符合经济成熟期的长周期规律，2025年预计会受到青睐，不管是具有穿越周期能力的消费成长细分赛道，还是受益于基本面相好的顺周期消费赛道都值得关注；当然，正如明年复苏的斜率和节奏预计清晰度尚不是很高，消费的投资可能需要一定耐心，配置消费的过程中难免阶段性地碰到诸如经济数据不佳、政策低于预期，以及在风格上被科技、红利、周期跑赢的情况，更需要以绝对收益的思路和耐心来对待。

数字经济明年可能面临主产业链向国内迁移的大背景（国内巨头企业加大资本开支），很多公司有机会经历从概念股到订单、业绩落地的过程，可能存在不错的投资机会；但对于绝对收益品种来说，其较大的波动和不确定的节奏不易把握，此外其中龙头公司站在目前时点，估值已经偏高，如果基本面兑现不及预期，可能带来戴维斯双杀；因此，从固收+资产配置的角度，一方面会控制这类资产在组合中的总仓位水平；另一方面投资过程中遵循不追高，在股价&情绪的较低位置逐渐布局的交易策略

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。

同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列

业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了ISAE3402（《国际鉴证业务准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。

本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1、在研究环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制；在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查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合规执行情况，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

3、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员及其配偶、利害关系人股票交易申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝老鼠仓、不公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及定投、费率优惠等基金销售业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规。在基金利用互联网平台营销方面，对各类新兴业务的活动方案进行事前合规评估，保证业务开展的同时注重事前风险防范；

5、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整、及时。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续以合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、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的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

|            |                            |
|------------|----------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                          |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                    |
| 审计报告编号     | 安永华明（2025）审字第80007653_B66号 |

6.2 审计报告的基本内容

|           |                                                                                                                                                                                                                |
|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题    | 审计报告                                                                                                                                                                                                           |
| 审计报告收件人   | 天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                |
| 审计意见      | 我们审计了天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金的财务报表，包括2024年12月31日的资产负债表，2024年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。<br>我们认为，后附的天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准                                                                                                                                                 |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | 则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。                                                                                                                                                                              |
| 强调事项            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 其他事项            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 其他信息            | <p>天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>                                            |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出                                                                                                                                                                                                                                          |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|           |                                                                      |     |
|-----------|----------------------------------------------------------------------|-----|
|           | 和事项。<br>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |     |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）                                                   |     |
| 注册会计师的姓名  | 蒋燕华                                                                  | 费泽旭 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层                                              |     |
| 审计报告日期    | 2025-03-27                                                           |     |

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

| 资产       | 附注号     | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|----------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产：      |         |                    |                     |
| 货币资金     | 7.4.7.1 | 1,045,263.79       | 56,142,463.40       |
| 结算备付金    |         | 25,343,226.80      | 19,414,858.44       |
| 存出保证金    |         | 50,216.60          | 59,827.05           |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 539,320,185.04     | 1,240,911,274.43    |
| 其中：股票投资  |         | 48,730,148.76      | 67,897,747.20       |
| 基金投资     |         | -                  | -                   |
| 债券投资     |         | 490,590,036.28     | 1,173,013,527.23    |
| 资产支持证券投资 |         | -                  | -                   |
| 贵金属投资    |         | -                  | -                   |
| 其他投资     |         | -                  | -                   |
| 衍生金融资产   | 7.4.7.3 | -                  | -                   |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | -                  | -                   |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 应收清算款         |            | 23,351,050.72              | -                           |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 99.21                      | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 7.4.7.5    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 589,110,042.16             | 1,316,528,423.32            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2023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        | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | 131,842,753.89             | 256,913,899.84              |
| 应付清算款         |            | 21,190,555.14              | 55,130,252.19               |
| 应付赎回款         |            | 3,491,351.48               | 3,220,233.74                |
| 应付管理人报酬       |            | 305,894.66                 | 694,421.26                  |
| 应付托管费         |            | 76,473.66                  | 173,605.30                  |
| 应付销售服务费       |            | 11,295.22                  | 20,109.54                   |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | 9,147.31                   | 39,109.25                   |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 7.4.7.6    | 218,799.99                 | 253,051.17                  |
| 负债合计          |            | 157,146,271.35             | 316,444,682.29              |
| <b>净资产:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 7.4.7.7    | 411,213,323.88             | 1,009,252,492.80            |
| 未分配利润         | 7.4.7.8    | 20,750,446.93              | -9,168,751.77               |
| 净资产合计         |            | 431,963,770.81             | 1,000,083,741.03            |
| 负债和净资产总计      |            | 589,110,042.16             | 1,316,528,423.32            |

注：报告截止日2024年12月31日，天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金A类基金份额净值1.0515元，天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金C类基金份

额净值1.0365元；基金份额总额411,213,323.88份，其中天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金A类基金份额381,751,730.17份，天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金C类基金份额29,461,593.71份。

7.2 利润表

会计主体：天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

| 项 目              | 附注号      | 本期<br>2024年01月01日至2<br>024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2<br>023年12月31日 |
|------------------|----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 一、营业总收入          |          | 50,008,883.36                     | 39,024,157.01                          |
| 1.利息收入           |          | 563,706.27                        | 513,026.26                             |
| 其中：存款利息收入        | 7.4.7.9  | 488,013.58                        | 492,858.49                             |
| 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       |          | 75,692.69                         | 20,167.77                              |
| 其他利息收入           |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | 20,919,049.00                     | -17,916,136.63                         |
| 其中：股票投资收益        | 7.4.7.10 | 2,674,684.07                      | -68,388,889.43                         |
| 基金投资收益           |          | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益           | 7.4.7.11 | 17,017,578.96                     | 47,434,001.83                          |
| 资产支持证券投资         | 7.4.7.12 | -                                 | -                                      |
| 收益               |          | -                                 | -                                      |
| 贵金属投资收益          | 7.4.7.13 | -                                 | -                                      |
| 衍生工具收益           | 7.4.7.14 | -                                 | -                                      |
| 股利收益             | 7.4.7.15 | 1,226,785.97                      | 3,038,750.97                           |
| 其他投资收益           |          | -                                 | -                                      |
| 3.公允价值变动收益（损失    | 7.4.7.16 | 28,526,128.09                     | 56,427,267.38                          |

|                     |          |               |               |
|---------------------|----------|---------------|---------------|
| 以“-”号填列)            |          |               |               |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列)   |          | -             | -             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列)   | 7.4.7.17 | -             | -             |
| 减：二、营业总支出           |          | 11,382,696.01 | 24,266,931.42 |
| 1.管理人报酬             |          | 5,677,383.89  | 11,301,185.00 |
| 2.托管费               |          | 1,419,345.92  | 2,825,296.26  |
| 3.销售服务费             |          | 183,329.50    | 305,673.83    |
| 4.投资顾问费             |          | -             | -             |
| 5.利息支出              |          | 3,818,957.68  | 9,485,059.23  |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 3,818,957.68  | 9,485,059.23  |
| 6.信用减值损失            | 7.4.7.18 | -             | -             |
| 7.税金及附加             |          | 36,515.22     | 79,821.68     |
| 8.其他费用              | 7.4.7.19 | 247,163.80    | 269,895.42    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列) |          | 38,626,187.35 | 14,757,225.59 |
| 减：所得税费用             |          | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列)   |          | 38,626,187.35 | 14,757,225.59 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -             | -             |
| 六、综合收益总额            |          | 38,626,187.35 | 14,757,225.59 |

7.3 净资产变动表

会计主体：天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期                      |       |       |
|-----|-------------------------|-------|-------|
|     | 2024年01月01日至2024年12月31日 |       |       |
|     | 实收基金                    | 未分配利润 | 净资产合计 |

|                                          |                                    |                |                  |
|------------------------------------------|------------------------------------|----------------|------------------|
| 一、上期期末净资产                                | 1,009,252,492.80                   | -9,168,751.77  | 1,000,083,741.03 |
| 二、本期期初净资产                                | 1,009,252,492.80                   | -9,168,751.77  | 1,000,083,741.03 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -598,039,168.92                    | 29,919,198.70  | -568,119,970.22  |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 38,626,187.35  | 38,626,187.35    |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -598,039,168.92                    | -8,706,988.65  | -606,746,157.57  |
| 其中：1.基金申购款                               | 546,059.33                         | 12,203.52      | 558,262.85       |
| 2.基金赎回款                                  | -598,585,228.25                    | -8,719,192.17  | -607,304,420.42  |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                  | -              | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 411,213,323.88                     | 20,750,446.93  | 431,963,770.81   |
| 项 目                                      | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |                |                  |
|                                          | 实收基金                               | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                | 1,897,995,733.88                   | -23,960,634.53 | 1,874,035,099.35 |
| 二、本期期初净资产                                | 1,897,995,733.88                   | -23,960,634.53 | 1,874,035,099.35 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -888,743,241.08                    | 14,791,882.76  | -873,951,358.32  |

|                                          |                  |               |                  |
|------------------------------------------|------------------|---------------|------------------|
| 填列)                                      |                  |               |                  |
| (一)、综合收益总额                               | -                | 14,757,225.59 | 14,757,225.59    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | -888,743,241.08  | 34,657.17     | -888,708,583.91  |
| 其中: 1.基金申购款                              | 1,225,007.73     | 363.62        | 1,225,371.35     |
| 2.基金赎回款                                  | -889,968,248.81  | 34,293.55     | -889,933,955.26  |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                | -             | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 1,009,252,492.80 | -9,168,751.77 | 1,000,083,741.03 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

高阳

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系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[2021]1068号《关于准予天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于2021年6月8日生效，首次设立募集规模为3,103,146,073.10份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金的投资范围为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（含中小板、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)。

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：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，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。

如果法律法规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。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2025年3月27日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年度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2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收

入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

#### 7.4.4.8 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 7.4.4.10 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确认。

以摊余成本计量的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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；通过红利再投资所得基金份额的最短持有期起始日与该认申购份额最短持有期起始日相同；

基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在履行适当程序后可酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制本基金财务报表时，需要作出估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及收入、费用、资产和负债的列报金额及其披露产生影响。这些估计和假设的不确定性所导致的结果可能造成对未来受影响的资产或负债的账面价值进行重大调整。

确定本基金以下类别金融资产（如涉及）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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于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。

(4) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，采用如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金（LOF）及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

（a）以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；

（b）以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值；

（c）如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 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。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；根据财政部、税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金

（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《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[2016]127号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 1,045,263.79       | 56,142,463.40       |
| 等于：本金        | 1,044,771.63       | 56,139,959.70       |
| 加：应计利息       | 492.16             | 2,503.70            |
| 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        | 1,045,263.79 | 56,142,463.40 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2024年12月31日  |              |                |               |
|---------------|-------|---------------------|--------------|----------------|---------------|
|               |       | 成本                  | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 42,326,797.29       | -            | 48,730,148.76  | 6,403,351.47  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                   | -            | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 242,136,880.81      | 2,799,645.31 | 249,759,919.91 | 4,823,393.79  |
|               | 银行间市场 | 233,961,181.86      | 2,636,816.37 | 240,830,116.37 | 4,232,118.14  |
|               | 合计    | 476,098,062.67      | 5,436,461.68 | 490,590,036.28 | 9,055,511.93  |
| 资产支持证券        |       | -                   | -            | -              | -             |
| 基金            |       | -                   | -            | -              | -             |
| 其他            |       | -                   | -            | -              | -             |
| 合计            |       | 518,424,859.96      | 5,436,461.68 | 539,320,185.04 | 15,458,863.40 |
| 项目            |       | 上年度末<br>2023年12月31日 |              |                |               |
|               |       | 成本                  | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 72,279,270.67       | -            | 67,897,747.20  | -4,381,523.47 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                   | -            | -              | -             |

|        |       |                  |               |                  |                |
|--------|-------|------------------|---------------|------------------|----------------|
| 债券     | 交易所市场 | 991,008,225.20   | 13,970,546.45 | 994,003,780.43   | -10,974,991.22 |
|        | 银行间市场 | 174,654,750.00   | 2,065,746.80  | 179,009,746.80   | 2,289,250.00   |
|        | 合计    | 1,165,662,975.20 | 16,036,293.25 | 1,173,013,527.23 | -8,685,741.22  |
| 资产支持证券 |       | -                | -             | -                | -              |
| 基金     |       | -                | -             | -                | -              |
| 其他     |       | -                | -             | -                | -              |
| 合计     |       | 1,237,942,245.87 | 16,036,293.25 | 1,240,911,274.43 | -13,067,264.69 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | -                  | -                   |
| 应付证券出借违约金   | -                  | -                   |
| 应付交易费用      | 19,499.99          | 33,751.17           |
| 其中：交易所市场    | 17,490.59          | 31,301.17           |
| 银行间市场       | 2,009.40           | 2,450.00            |

|      |            |            |
|------|------------|------------|
| 应付利息 | -          | -          |
| 预提费用 | 199,300.00 | 219,300.00 |
| 合计   | 218,799.99 | 253,051.17 |

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 天弘安康颐享12个月持有A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(天弘安康颐享12个月持有A) | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 |                 |
|-----------------------|-------------------------------|-----------------|
|                       | 基金份额（份）                       | 账面金额            |
| 上年度末                  | 949,873,478.02                | 949,873,478.02  |
| 本期申购                  | 334,228.95                    | 334,228.95      |
| 本期赎回（以“-”号填列）         | -568,455,976.80               | -568,455,976.80 |
| 本期末                   | 381,751,730.17                | 381,751,730.17  |

7.4.7.7.2 天弘安康颐享12个月持有C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(天弘安康颐享12个月持有C) | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 |                |
|-----------------------|-------------------------------|----------------|
|                       | 基金份额（份）                       | 账面金额           |
| 上年度末                  | 59,379,014.78                 | 59,379,014.78  |
| 本期申购                  | 211,830.38                    | 211,830.38     |
| 本期赎回（以“-”号填列）         | -30,129,251.45                | -30,129,251.45 |
| 本期末                   | 29,461,593.71                 | 29,461,593.71  |

注：赎回含转换转出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 天弘安康颐享12个月持有A

单位：人民币元

| 项目<br>(天弘安康颐享12个月持有A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-----------------------|-------|-------|---------|
|                       |       |       |         |

|                |                |                |               |
|----------------|----------------|----------------|---------------|
| 上年度末           | -12,751,540.17 | 4,689,766.97   | -8,061,773.20 |
| 本期期初           | -12,751,540.17 | 4,689,766.97   | -8,061,773.20 |
| 本期利润           | 9,524,812.84   | 26,773,669.69  | 36,298,482.53 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 6,527,423.06   | -15,087,837.20 | -8,560,414.14 |
| 其中：基金申购款       | -3,851.83      | 11,615.73      | 7,763.90      |
| 基金赎回款          | 6,531,274.89   | -15,099,452.93 | -8,568,178.04 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -             |
| 本期末            | 3,300,695.73   | 16,375,599.46  | 19,676,295.19 |

7.4.7.8.2 天弘安康颐享12个月持有C

单位：人民币元

| 项目<br>(天弘安康颐享12个月持有C) | 已实现部分         | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
|-----------------------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末                  | -1,391,652.60 | 284,674.03   | -1,106,978.57 |
| 本期期初                  | -1,391,652.60 | 284,674.03   | -1,106,978.57 |
| 本期利润                  | 575,246.42    | 1,752,458.40 | 2,327,704.82  |
| 本期基金份额交易产生的变动数        | 648,760.68    | -795,335.19  | -146,574.51   |
| 其中：基金申购款              | -5,277.62     | 9,717.24     | 4,439.62      |
| 基金赎回款                 | 654,038.30    | -805,052.43  | -151,014.13   |
| 本期已分配利润               | -             | -            | -             |
| 本期末                   | -167,645.50   | 1,241,797.24 | 1,074,151.74  |

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2024年01月01日至2024年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年<br>12月31日 |
|----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 24,245.62                         | 115,457.15                             |
| 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 | 463,051.06 | 374,867.02 |
| 其他        | 716.90     | 2,534.32   |
| 合计        | 488,013.58 | 492,858.49 |

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2024年01月01日至2024年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年<br>12月31日 |
|------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 164,894,835.69                    | 695,058,802.27                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 161,937,158.99                    | 762,191,592.57                         |
| 减：交易费用     | 282,992.63                        | 1,256,099.13                           |
| 买卖股票差价收入   | 2,674,684.07                      | -68,388,889.43                         |

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                                   | 本期<br>2024年01月01日至2024年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年<br>12月31日 |
|--------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                         | 22,420,436.73                     | 45,596,243.49                          |
| 债券投资收益——买卖债券<br>（债转股及债券到期兑付）<br>差价收入 | -5,402,857.77                     | 1,837,758.34                           |
| 债券投资收益——赎回差价<br>收入                   | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益——申购差价<br>收入                   | -                                 | -                                      |
| 合计                                   | 17,017,578.96                     | 47,434,001.83                          |

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月<br>31日 |
|------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,515,031,962.56                  | 1,826,831,747.10                       |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,499,943,839.19                  | 1,797,455,547.46                       |
| 减：应计利息总额               | 20,466,088.80                     | 27,520,242.55                          |
| 减：交易费用                 | 24,892.34                         | 18,198.75                              |
| 买卖债券差价收入               | -5,402,857.77                     | 1,837,758.34                           |

**7.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

**7.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间未取得贵金属投资收益。

**7.4.7.14 衍生工具收益**

**7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间未取得买卖权证差价收入。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间未取得其他衍生工具投资收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024年01月01日至2024<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023<br>年12月31日 |
|---------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,226,785.97                      | 3,038,750.97                           |
| 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          | 1,226,785.97 | 3,038,750.97 |

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |
|------------------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 28,526,128.09                 | 56,427,267.38                      |
| ——股票投资                 | 10,784,874.94                 | 49,607,720.38                      |
| ——债券投资                 | 17,741,253.15                 | 6,819,547.00                       |
| ——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                     | 28,526,128.09                 | 56,427,267.38                      |

7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间未取得其他收入。

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |
|----|-------------------------------|------------------------------------|
|    |                               |                                    |

|          |            |            |
|----------|------------|------------|
| 审计费用     | 70,000.00  | 90,000.00  |
| 信息披露费    | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金  | -          | -          |
| 汇划手续费    | 18,605.24  | 21,351.36  |
| 银行间账户维护费 | 37,200.00  | 37,200.00  |
| 证券组合费    | 1,358.56   | 1,344.06   |
| 合计       | 247,163.80 | 269,895.42 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

| 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 |
| 中国民生银行股份有限公司         | 基金托管人、基金销售机构          |
| 蚂蚁科技集团股份有限公司         | 基金管理人的股东              |
| 天津信托有限责任公司           | 基金管理人的股东              |
| 内蒙古君正能源化工集团股份有限公司    | 基金管理人的股东              |
| 芜湖高新投资有限公司           | 基金管理人的股东              |
| 新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东              |
| 新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东              |
| 新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东              |
| 新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东              |

|              |             |
|--------------|-------------|
| 天弘创新资产管理有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |
|--------------|-------------|

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。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**7.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

**7.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

**7.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

**7.4.10.2 关联方报酬**

**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024年01月01日至20<br>24年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至20<br>23年12月31日 |
|------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 5,677,383.89                      | 11,301,185.00                          |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 2,837,029.13                      | 5,647,727.82                           |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 2,840,354.76                      | 5,653,457.18                           |

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0.80%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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024年01月01日至2024<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023<br>年12月31日 |
|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,419,345.92                      | 2,825,296.26                           |

注:支付基金托管人中国民生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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日      |               |            |
|----------------------------|------------------------------------|---------------|------------|
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |               |            |
|                            | 天弘安康颐享12个月持有A                      | 天弘安康颐享12个月持有C | 合计         |
| 天弘基金<br>管理有限<br>公司         | -                                  | 62.39         | 62.39      |
| 中国民生<br>银行股份<br>有限公司       | -                                  | 183,267.11    | 183,267.11 |
| 合计                         | -                                  | 183,329.50    | 183,329.50 |
| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |               |            |
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |               |            |
|                            | 天弘安康颐享12个月持有A                      | 天弘安康颐享12个月持有C | 合计         |
| 天弘基金<br>管理有限<br>公司         | -                                  | 381.89        | 381.89     |

|                      |   |            |            |
|----------------------|---|------------|------------|
| 中国民生<br>银行股份<br>有限公司 | - | 305,291.94 | 305,291.94 |
| 合计                   | - | 305,673.83 | 305,673.83 |

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。天弘安康颐享12个月持有C的销售服务费率为0.40%。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、天弘安康颐享12个月持有A不收取销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日      |          |                   |       |      |       |      |
|------------------------------------|----------|-------------------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交<br>易的各关联方<br>名称             | 债券交易金额   |                   | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                    | 基金买<br>入 | 基金卖出              | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 中国民生银行<br>股份有限公司                   | -        | 23,385,641.<br>00 | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |          |                   |       |      |       |      |
| 银行间市场交<br>易的<br>各关联方名称             | 债券交易金额   |                   | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                    | 基金买<br>入 | 基金卖出              | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| -                                  | -        | -                 | -     | -    | -     | -    |

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 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

天弘安康颐享12个月持有A

本报告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。

天弘安康颐享12个月持有C

本报告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。

7.4.10.6 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<br>2024年01月01日至2024年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |            |
|--------------|-------------------------------|-----------|------------------------------------|------------|
|              | 期末余额                          | 当期利息收入    | 期末余额                               | 当期利息收入     |
| 中国民生银行股份有限公司 | 1,045,263.79                  | 24,245.62 | 56,142,463.40                      | 115,457.15 |

注：本基金由基金托管人中国民生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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

天弘安康颐享12个月持有A

本报告期无利润分配事项。

天弘安康颐享12个月持有C

本报告期无利润分配事项。

#### **7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

##### **7.4.12.1 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。

##### **7.4.12.2 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。

##### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2024年12月31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。

###### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2024年12月31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131,842,753.89元，于2025年01月02日、2025年01月07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。

##### **7.4.12.4 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。

#### **7.4.13 金融工具风险及管理**

##### **7.4.13.1 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，建立了以风险委员会为核心的、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。在董事会下设立风险委员会，负责审议风险管理的宏观政策，指导

监督公司风险管理目标的落实等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责指导、协调和监督各业务或职能部门开展风险管理工作；决定公司风险控制政策和程序，审批公司风险管理标准和重要业务风险管理口径；听取风险汇报，并就报告的重大风险管理事项进行决策；听取创新业务或产品风险评估报告；组织和协调重大风险事件的应对，直至风险得到妥善处理；审议公司重要的风险管理制度和流程。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。风险管理部由督察长分管。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

#### 7.4.13.2 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民生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。

**7.4.13.2.1 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<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | 87,458,933.59       |
| 合计     | -                  | 87,458,933.59       |

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。

**7.4.13.2.2 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。

**7.4.13.2.3 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。

**7.4.13.2.4 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<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 379,075,292.53     | 763,071,874.27      |
| AAA以下  | 25,227,924.88      | 122,721,733.12      |
| 未评级    | 86,286,818.87      | 199,760,986.25      |
| 合计     | 490,590,036.28     | 1,085,554,593.64    |

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。

**7.4.13.2.5 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。

**7.4.13.2.6 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。

### 7.4.13.3 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在基金最短持有期限到期日起（含当日）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于开放期内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2024年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有131,852,000.00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（净资产）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。

#### 7.4.13.3.1 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》且于基金开放期内按照《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公司的证券不得超过该证券的10%。于开放期内，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7.4.12。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。

于开放期内，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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024年12月31日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计            |
|--------------------|---------------|------|------|-----|---------------|
| 资产                 |               |      |      |     |               |
| 货币资金               | 1,045,263.79  | -    | -    | -   | 1,045,263.79  |
| 结算备付金              | 25,343,226.80 | -    | -    | -   | 25,343,226.80 |

|                     |                |                |                |               |                  |
|---------------------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 存出保证金               | 50,216.60      | -              | -              | -             | 50,216.60        |
| 交易性金融资产             | 32,082,731.10  | 408,632,141.45 | 49,875,163.73  | 48,730,148.76 | 539,320,185.04   |
| 应收清算款               | -              | -              | -              | 23,351,050.72 | 23,351,050.72    |
| 应收申购款               | -              | -              | -              | 99.21         | 99.21            |
| 资产总计                | 58,521,438.29  | 408,632,141.45 | 49,875,163.73  | 72,081,298.69 | 589,110,042.16   |
| 负债                  |                |                |                |               |                  |
| 卖出回购金融资产款           | 131,842,753.89 | -              | -              | -             | 131,842,753.89   |
| 应付清算款               | -              | -              | -              | 21,190,555.14 | 21,190,555.14    |
| 应付赎回款               | -              | -              | -              | 3,491,351.48  | 3,491,351.48     |
| 应付管理人报酬             | -              | -              | -              | 305,894.66    | 305,894.66       |
| 应付托管费               | -              | -              | -              | 76,473.66     | 76,473.66        |
| 应付销售服务费             | -              | -              | -              | 11,295.22     | 11,295.22        |
| 应交税费                | -              | -              | -              | 9,147.31      | 9,147.31         |
| 其他负债                | -              | -              | -              | 218,799.99    | 218,799.99       |
| 负债总计                | 131,842,753.89 | -              | -              | 25,303,517.46 | 157,146,271.35   |
| 利率敏感度缺口             | -73,321,315.60 | 408,632,141.45 | 49,875,163.73  | 46,777,781.23 | 431,963,770.81   |
| 上年度末<br>2023年12月31日 | 1年以内           | 1-5年           | 5年以上           | 不计息           | 合计               |
| 资产                  |                |                |                |               |                  |
| 货币资金                | 56,142,463.40  | -              | -              | -             | 56,142,463.40    |
| 结算备付金               | 19,414,858.44  | -              | -              | -             | 19,414,858.44    |
| 存出保证金               | 59,827.05      | -              | -              | -             | 59,827.05        |
| 交易性金融资产             | 526,522,928.12 | 503,443,287.18 | 143,047,311.93 | 67,897,747.20 | 1,240,911,274.43 |
| 资产总计                | 602,140,077.01 | 503,443,287.18 | 143,047,311.93 | 67,897,747.20 | 1,316,528,423.32 |
| 负债                  |                |                |                |               |                  |
| 卖出回购金融资产款           | 256,913,899.84 | -              | -              | -             | 256,913,899.84   |
| 应付清算款               | -              | -              | -              | 55,130,252.1  | 55,130,252.19    |

|         |                |                |                |               |                  |
|---------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
|         |                |                |                | 9             |                  |
| 应付赎回款   | -              | -              | -              | 3,220,233.74  | 3,220,233.74     |
| 应付管理人报酬 | -              | -              | -              | 694,421.26    | 694,421.26       |
| 应付托管费   | -              | -              | -              | 173,605.30    | 173,605.30       |
| 应付销售服务费 | -              | -              | -              | 20,109.54     | 20,109.54        |
| 应交税费    | -              | -              | -              | 39,109.25     | 39,109.25        |
| 其他负债    | -              | -              | -              | 253,051.17    | 253,051.17       |
| 负债总计    | 256,913,899.84 | -              | -              | 59,530,782.45 | 316,444,682.29   |
| 利率敏感度缺口 | 345,226,177.17 | 503,443,287.18 | 143,047,311.93 | 8,366,964.75  | 1,000,083,741.03 |

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。

7.4.13.4.1.2 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<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2024年12月31日              | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|    | 市场利率下降25个基点        | 3,925,892.61                    | 9,026,837.82        |
|    | 市场利率上升25个基点        | -3,821,269.63                   | -8,670,029.78       |

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024年12月31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 |
|    |                    |         |           |    |

|               |                     |               |           |               |
|---------------|---------------------|---------------|-----------|---------------|
|               |                     |               | 币         |               |
| 以外币计价的资产      |                     |               |           |               |
| 交易性金融资产       | -                   | 13,074,758.76 | -         | 13,074,758.76 |
| 资产合计          | -                   | 13,074,758.76 | -         | 13,074,758.76 |
| 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 | -                   | 13,074,758.76 | -         | 13,074,758.76 |
| 项目            | 上年度末<br>2023年12月31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       | -                   | 19,904,801.50 | -         | 19,904,801.50 |
| 资产合计          | -                   | 19,904,801.50 | -         | 19,904,801.50 |
| 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 | -                   | 19,904,801.50 | -         | 19,904,801.50 |

7.4.13.4.2.2 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<br>2024年12月31日          | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|    | 所有外币相对人民币升值5%    | 653,737.94                  | 995,240.08          |
|    | 所有外币相对人民币贬值5%    | -653,737.94                 | -995,240.08         |

7.4.13.4.3 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，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。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2024年12月31日 |                          | 上年度末<br>2023年12月31日 |                          |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 48,730,148.76      | 11.28                    | 67,897,747.20       | 6.79                     |
| 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 | 48,730,148.76 | 11.28 | 67,897,747.20 | 6.79 |
|----|---------------|-------|---------------|------|

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2024年12月31日，本基金持有的交易性权益类投资占基金净资产的比例为11.28%(2023年12月31日：6.79%)，因此其他价格风险对于本基金净资产无重大影响(2023年12月31日：同)。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 80,278,899.21      | 257,705,435.65      |
| 第二层次          | 459,041,285.83     | 982,687,465.06      |
| 第三层次          | -                  | 518,373.72          |
| 合计            | 539,320,185.04     | 1,240,911,274.43    |

7.4.14.2.2 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。

对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目                                         | 本期                      |              |              |
|--------------------------------------------|-------------------------|--------------|--------------|
|                                            | 2024年01月01日至2024年12月31日 |              |              |
|                                            | 交易性金融资产                 |              | 合计           |
|                                            | 债券投资                    | 股票投资         |              |
| 期初余额                                       | -                       | 518,373.72   | 518,373.72   |
| 当期购买                                       | -                       | -            | -            |
| 当期出售/结算                                    | -                       | -            | -            |
| 转入第三层次                                     | -                       | -            | -            |
| 转出第三层次                                     | -                       | 452,818.70   | 452,818.70   |
| 当期利得或损失总额                                  | -                       | -65,555.02   | -65,555.02   |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -                       | -65,555.02   | -65,555.02   |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -                       | -            | -            |
| 期末余额                                       | -                       | -            | -            |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -                       | -            | -            |
| 项目                                         | 上年度可比期间                 |              |              |
|                                            | 2023年01月01日至2023年12月31日 |              |              |
|                                            | 交易性金融资产                 |              | 合计           |
|                                            | 债券投资                    | 股票投资         |              |
| 期初余额                                       | -                       | 3,890,266.72 | 3,890,266.72 |
| 当期购买                                       | -                       | -            | -            |
| 当期出售/结算                                    | -                       | -            | -            |
| 转入第三层次                                     | -                       | 2,753,355.13 | 2,753,355.13 |
| 转出第三层次                                     | -                       | 6,379,482.20 | 6,379,482.20 |
| 当期利得或损失总额                                  | -                       | 254,234.07   | 254,234.07   |

|                                            |   |             |             |
|--------------------------------------------|---|-------------|-------------|
| 其中：计入损益的利得或损失                              | - | 254,234.07  | 254,234.07  |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | - | -           | -           |
| 期末余额                                       | - | 518,373.72  | 518,373.72  |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | -162,573.05 | -162,573.05 |

注：于2024年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

| 项目   | 本期末公允价值    | 采用的估值技术    | 不可观察输入值 |               |            |
|------|------------|------------|---------|---------------|------------|
|      |            |            | 名称      | 范围/加权平均值      | 与公允价值之间的关系 |
| 股票投资 | -          | -          | -       | -             | -          |
| 项目   | 上年度末公允价值   | 采用的估值技术    | 不可观察输入值 |               |            |
|      |            |            | 名称      | 范围/加权平均值      | 与公允价值之间的关系 |
| 股票投资 | 518,373.72 | 平均价格亚式期权模型 | 预期年化波动率 | 0.1969~0.6725 | 负相关        |

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023年12月31日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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              | 48,730,148.76  | 8.27         |
|    | 其中：股票             | 48,730,148.76  | 8.27         |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 490,590,036.28 | 83.28        |
|    | 其中：债券             | 490,590,036.28 | 83.28        |
|    | 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      | 26,388,490.59  | 4.48         |
| 8  | 其他各项资产            | 23,401,366.53  | 3.97         |
| 9  | 合计                | 589,110,042.16 | 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13,074,758.76元，占基金资产净值的比例为3.03%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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 | -       | -            |
| B  | 采矿业      | -       | -            |

|   |                  |               |      |
|---|------------------|---------------|------|
| C | 制造业              | 24,051,990.00 | 5.57 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -    |
| E | 建筑业              | -             | -    |
| F | 批发和零售业           | -             | -    |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 5,702,500.00  | 1.32 |
| 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              | 4,494,900.00  | 1.04 |
| K | 房地产业             | -             | -    |
| L | 租赁和商务服务业         | 1,406,000.00  | 0.33 |
| M | 科学研究和技术服务业       | -             | -    |
| 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               | 35,655,390.00 | 8.25 |

### 8.2.2 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 | 4,357,018.20 | 1.01         |
| 日常消费品    | -            | -            |
| 能源       | -            | -            |
| 金融       | -            | -            |
| 医疗保健     | -            | -            |
| 工业       | -            | -            |
| 信息技术     | 1,766,884.32 | 0.41         |
| 电信服务     | 6,950,856.24 | 1.61         |
| 公用事业     | -            | -            |

|     |               |      |
|-----|---------------|------|
| 地产业 | -             | -    |
| 合计  | 13,074,758.76 | 3.03 |

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

8.3 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  | 00700  | 腾讯控股 | 18,000  | 6,950,856.24 | 1.61         |
| 2  | 09896  | 名创优品 | 100,000 | 4,357,018.20 | 1.01         |
| 3  | 600989 | 宝丰能源 | 200,000 | 3,368,000.00 | 0.78         |
| 4  | 002064 | 华峰化学 | 400,000 | 3,272,000.00 | 0.76         |
| 5  | 600428 | 中远海特 | 400,000 | 2,920,000.00 | 0.68         |
| 6  | 601601 | 中国太保 | 80,000  | 2,726,400.00 | 0.63         |
| 7  | 600276 | 恒瑞医药 | 57,100  | 2,620,890.00 | 0.61         |
| 8  | 002371 | 北方华创 | 6,000   | 2,346,000.00 | 0.54         |
| 9  | 002138 | 顺络电子 | 60,000  | 1,888,800.00 | 0.44         |
| 10 | 600298 | 安琪酵母 | 50,000  | 1,802,500.00 | 0.42         |
| 11 | 600036 | 招商银行 | 45,000  | 1,768,500.00 | 0.41         |
| 12 | 00981  | 中芯国际 | 60,000  | 1,766,884.32 | 0.41         |
| 13 | 002507 | 涪陵榨菜 | 120,000 | 1,695,600.00 | 0.39         |
| 14 | 600029 | 南方航空 | 250,000 | 1,622,500.00 | 0.38         |
| 15 | 301498 | 乖宝宠物 | 20,000  | 1,566,400.00 | 0.36         |
| 16 | 601058 | 赛轮轮胎 | 100,000 | 1,433,000.00 | 0.33         |
| 17 | 002027 | 分众传媒 | 200,000 | 1,406,000.00 | 0.33         |
| 18 | 600482 | 中国动力 | 50,000  | 1,223,500.00 | 0.28         |
| 19 | 600026 | 中远海能 | 100,000 | 1,160,000.00 | 0.27         |
| 20 | 600690 | 海尔智家 | 40,000  | 1,138,800.00 | 0.26         |
| 21 | 300760 | 迈瑞医疗 | 4,000   | 1,020,000.00 | 0.24         |
| 22 | 000807 | 云铝股份 | 50,000  | 676,500.00   | 0.16         |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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  | 600989 | 宝丰能源 | 5,590,895.00 | 0.56           |
| 2  | 603606 | 东方电缆 | 4,880,606.00 | 0.49           |
| 3  | 601601 | 中国太保 | 4,879,453.00 | 0.49           |
| 4  | 00700  | 腾讯控股 | 4,789,380.50 | 0.48           |
| 5  | 002475 | 立讯精密 | 4,775,743.76 | 0.48           |
| 6  | 600150 | 中国船舶 | 4,019,574.80 | 0.40           |
| 7  | 01138  | 中远海能 | 3,974,662.12 | 0.40           |
| 8  | 002371 | 北方华创 | 3,973,788.00 | 0.40           |
| 9  | 002027 | 分众传媒 | 3,851,921.00 | 0.39           |
| 10 | 09896  | 名创优品 | 3,740,503.74 | 0.37           |
| 11 | 301498 | 乖宝宠物 | 3,514,964.77 | 0.35           |
| 12 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,506,132.00 | 0.35           |
| 13 | 600036 | 招商银行 | 3,403,898.00 | 0.34           |
| 14 | 002064 | 华峰化学 | 3,052,204.00 | 0.31           |
| 15 | 600482 | 中国动力 | 2,970,869.00 | 0.30           |
| 16 | 600690 | 海尔智家 | 2,740,037.00 | 0.27           |
| 17 | 002142 | 宁波银行 | 2,714,795.10 | 0.27           |
| 18 | 000988 | 华工科技 | 2,643,258.00 | 0.26           |
| 19 | 600176 | 中国巨石 | 2,578,684.00 | 0.26           |
| 20 | 002468 | 申通快递 | 2,505,156.00 | 0.25           |

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。

8.4.2 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<br>资产净值比<br>例(%) |
|----|--------|--------|---------------|------------------------|
| 1  | 00883  | 中国海洋石油 | 10,122,268.04 | 1.01                   |
| 2  | 300408 | 三环集团   | 8,238,544.00  | 0.82                   |
| 3  | 600519 | 贵州茅台   | 7,676,005.00  | 0.77                   |
| 4  | 002475 | 立讯精密   | 6,531,753.00  | 0.65                   |
| 5  | 002601 | 龙佰集团   | 5,405,804.00  | 0.54                   |
| 6  | 600900 | 长江电力   | 4,865,707.00  | 0.49                   |
| 7  | 603606 | 东方电缆   | 4,568,090.00  | 0.46                   |
| 8  | 600150 | 中国船舶   | 4,549,763.00  | 0.45                   |
| 9  | 01818  | 招金矿业   | 4,510,733.28  | 0.45                   |
| 10 | 00700  | 腾讯控股   | 4,283,620.11  | 0.43                   |
| 11 | 300308 | 中际旭创   | 3,837,283.00  | 0.38                   |
| 12 | 600176 | 中国巨石   | 3,500,035.00  | 0.35                   |
| 13 | 301498 | 乖宝宠物   | 3,342,327.06  | 0.33                   |
| 14 | 601601 | 中国太保   | 3,336,142.00  | 0.33                   |
| 15 | 01138  | 中远海能   | 3,289,815.98  | 0.33                   |
| 16 | 002027 | 分众传媒   | 2,910,821.00  | 0.29                   |
| 17 | 00728  | 中国电信   | 2,836,760.59  | 0.28                   |
| 18 | 300498 | 温氏股份   | 2,782,619.27  | 0.28                   |
| 19 | 600989 | 宝丰能源   | 2,668,457.00  | 0.27                   |
| 20 | 601628 | 中国人寿   | 2,587,034.00  | 0.26                   |

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。

8.4.3 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 | 131,984,685.61 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 164,894,835.69 |

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。

8.5 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      | 49,793,353.39  | 11.53        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 201,646,786.95 | 46.68        |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 192,162,919.46 | 44.49        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 15,438,226.03  | 3.57         |
| 7  | 可转债(可交换债) | 31,548,750.45  | 7.30         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 490,590,036.28 | 113.57       |

8.6 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  | 149634  | 21广发11      | 400,000 | 41,492,328.77 | 9.61         |
| 2  | 188763  | 21光证G9      | 400,000 | 41,488,328.77 | 9.60         |
| 3  | 2422009 | 24工银金租债02   | 400,000 | 41,455,213.15 | 9.60         |
| 4  | 188171  | 21保利05      | 400,000 | 41,069,468.49 | 9.51         |
| 5  | 2422020 | 24兴业消费金融债03 | 400,000 | 41,026,527.12 | 9.50         |

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【交银金融租赁有限责任公司】于2024年12月10日收到国家金融监督管理总局上海监管局出具公开处罚的通报；【兴业消费金融股份公司】于2024年06月27日收到国家金融监督管理总局泉州监管分局出具公开处罚的通报；【中国平安财产保险股份有限公司】于2024年05月14日收到国家金融监督管理总局出具公开处罚的通报，于2024年06月03日收到国家金融监督管理总局商洛监管分局出具公开处罚的通报，于2024年12月23日收到国家金融监督管理总局山东监管局出具公开处罚的通报。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

8.12.2 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。

8.12.3 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 | 50,216.60     |
| 2  | 应收清算款 | 23,351,050.72 |
| 3  | 应收股利  | -             |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 99.21         |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 23,401,366.53 |

8.12.4 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  | 113050 | 南银转债 | 4,121,253.59 | 0.95         |
| 2  | 113061 | 拓普转债 | 3,583,336.18 | 0.83         |
| 3  | 118013 | 道通转债 | 2,789,054.19 | 0.65         |
| 4  | 127100 | 神码转债 | 2,735,391.97 | 0.63         |
| 5  | 113682 | 益丰转债 | 2,453,244.08 | 0.57         |
| 6  | 113052 | 兴业转债 | 2,199,571.98 | 0.51         |
| 7  | 113624 | 正川转债 | 1,899,519.10 | 0.44         |
| 8  | 127082 | 亚科转债 | 1,785,128.13 | 0.41         |
| 9  | 127086 | 恒邦转债 | 1,677,945.29 | 0.39         |
| 10 | 113641 | 华友转债 | 1,627,048.72 | 0.38         |
| 11 | 113647 | 禾丰转债 | 1,597,717.92 | 0.37         |
| 12 | 123108 | 乐普转2 | 882,136.80   | 0.20         |
| 13 | 123113 | 仙乐转债 | 866,153.98   | 0.20         |
| 14 | 127070 | 大中转债 | 537,914.83   | 0.12         |
| 15 | 127066 | 科利转债 | 171,756.88   | 0.04         |

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |       |
|------|----|-----------|-------|-------|
|      |    |           | 机构投资者 | 个人投资者 |

|               | 人<br>户<br>数<br>(户) |            | 持有份额 | 占总<br>份额<br>比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
|---------------|--------------------|------------|------|----------------|----------------|------------|
| 天弘安康颐享12个月持有A | 2,674              | 142,764.30 | -    | -              | 381,751,730.17 | 100.00%    |
| 天弘安康颐享12个月持有C | 235                | 125,368.48 | -    | -              | 29,461,593.71  | 100.00%    |
| 合计            | 2,889              | 142,337.60 | -    | -              | 411,213,323.88 | 100.00%    |

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）。

9.2 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<br>(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 | 天弘安康颐享12个月持有A | 130.19        | 0.00%    |
|                  | 天弘安康颐享12个月持有C | 1,108.72      | 0.00%    |
|                  | 合计            | 1,238.91      | 0.00%    |

9.3 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 | 天弘安康颐享12个月持有A | 0                 |

|                 |               |   |
|-----------------|---------------|---|
| 基金              | 天弘安康颐享12个月持有C | 0 |
|                 | 合计            | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 天弘安康颐享12个月持有A | 0 |
|                 | 天弘安康颐享12个月持有C | 0 |
|                 | 合计            | 0 |

§10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 天弘安康颐享12个月持有A    | 天弘安康颐享12个月持有C  |
|----------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2021年06月08日)基金份额总额 | 2,925,434,169.43 | 177,711,903.67 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 949,873,478.02   | 59,379,014.78  |
| 本报告期基金总申购份额                | 334,228.95       | 211,830.38     |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 568,455,976.80   | 30,129,251.45  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 381,751,730.17   | 29,461,593.71  |

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，聂挺进先生新任公司副总经理，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高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，黄辰立先生担任公司董事长，韩歆毅先生不再担任公司董事长，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董事长变更的公告》。

本报告期内，熊军先生不再担任公司副总经理，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高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期内本基金应向安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费70,000.00元。截至本报告期末，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务4个月。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

11.6.2 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，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 |    |
| 广发   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|        |   |                |        |           |        |   |
|--------|---|----------------|--------|-----------|--------|---|
| 证券     |   |                |        |           |        |   |
| 国盛证券   | 2 | 121,003,110.18 | 40.76% | 63,839.52 | 44.31% | - |
| 华福证券   | 1 | 33,773,128.39  | 11.38% | 15,059.98 | 10.45% | - |
| 华西证券   | 1 | 17,133,670.43  | 5.77%  | 7,761.35  | 5.39%  | - |
| 开源证券   | 1 | 69,570,739.36  | 23.43% | 31,250.13 | 21.69% | - |
| 西部证券   | 1 | 13,000,640.00  | 4.38%  | 5,797.02  | 4.02%  | - |
| 中泰证券   | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 中信建投证券 | 3 | 42,398,232.94  | 14.28% | 20,373.50 | 14.14% | - |

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；具有较强的综合服务能力，能及时、全面提供高质量的关于宏观策略、行业、资本市场、个股分析的研究服务及丰富全面的信息咨询服务；具有较强的证券交易服务能力，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务及合理的佣金费率。

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：中信建投证券上海交易单元2个，中信建投证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：中泰证券深圳交易单元1个。

5、本基金管理人严格落实《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》的要求，2024年6月30日前完成股票交易佣金费率的调整。6月30日前的股票交易佣金费率按照原费率执行，7月1日起按照调整后的费率执行。

11.7.2 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<br>债券成<br>交总额<br>的比例 | 成交金额                  | 占当期<br>债券回<br>购成交<br>总额的<br>比例 | 成交金<br>额 | 占当期<br>权证成<br>交总额<br>的比例 | 成交金<br>额 | 占当期<br>基金成<br>交总额<br>的比例 |
|------------|--------------------|--------------------------|-----------------------|--------------------------------|----------|--------------------------|----------|--------------------------|
| 广发证券       | -                  | -                        | -                     | -                              | -        | -                        | -        | -                        |
| 国盛证券       | 225,351,06<br>5.07 | 39.20%                   | 29,628,368,00<br>0.00 | 71.03%                         | -        | -                        | -        | -                        |
| 华福证券       | 22,522,764.<br>17  | 3.92%                    | 456,081,000.0<br>0    | 1.09%                          | -        | -                        | -        | -                        |
| 华西证券       | 92,711,595.<br>37  | 16.13%                   | 3,958,380,000.<br>00  | 9.49%                          | -        | -                        | -        | -                        |
| 开源证券       | 115,173,85<br>7.00 | 20.04%                   | 543,957,000.0<br>0    | 1.30%                          | -        | -                        | -        | -                        |
| 西部证券       | -                  | -                        | 1,262,800,000.<br>00  | 3.03%                          | -        | -                        | -        | -                        |
| 中泰证券       | -                  | -                        | -                     | -                              | -        | -                        | -        | -                        |
| 中信建投<br>证券 | 119,076,17<br>4.09 | 20.71%                   | 5,864,994,000.<br>00  | 14.06%                         | -        | -                        | -        | -                        |

11.8 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  | 天弘安康颐享12个月持有期<br>混合型证券投资基金2023年<br>第4季度报告            | 中国证监会规定媒介 | 2024-01-22 |
| 2  | 天弘基金将严格落实《证监<br>会新闻发言人就“两融”融<br>券业务有关情况答记者问》<br>相关要求 | 中国证监会规定媒介 | 2024-02-06 |
| 3  | 天弘基金管理有限公司关于<br>基金经理助理的任职公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-08 |
| 4  | 天弘安康颐享12个月持有期<br>混合型证券投资基金招募说<br>明书（更新）              | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-08 |
| 5  | 天弘基金管理有限公司关于<br>基金经理助理的任职公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-26 |
| 6  | 天弘安康颐享12个月持有期<br>混合型证券投资基金2023年                      | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-29 |

|    |                                             |           |            |
|----|---------------------------------------------|-----------|------------|
|    | 年度报告                                        |           |            |
| 7  | 天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要(更新)    | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-29 |
| 8  | 天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要(更新)    | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-29 |
| 9  | 天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                     | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-30 |
| 10 | 天弘基金管理有限公司关于调整天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金基金经理的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-04-03 |
| 11 | 天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金招募说明书(更新)             | 中国证监会规定媒介 | 2024-04-09 |
| 12 | 天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要(更新)    | 中国证监会规定媒介 | 2024-04-09 |
| 13 | 天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要(更新)    | 中国证监会规定媒介 | 2024-04-09 |
| 14 | 天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金2024年第1季度报告           | 中国证监会规定媒介 | 2024-04-22 |
| 15 | 天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要(更新)    | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-28 |

|    |                                               |           |            |
|----|-----------------------------------------------|-----------|------------|
| 16 | 天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要(更新)      | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-28 |
| 17 | 天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金2024年第2季度报告             | 中国证监会规定媒介 | 2024-07-19 |
| 18 | 天弘基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告     | 中国证监会规定媒介 | 2024-08-02 |
| 19 | 天弘基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售(上海)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-08-20 |
| 20 | 天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金2024年中期报告               | 中国证监会规定媒介 | 2024-08-30 |
| 21 | 天弘基金管理有限公司关于基金经理助理的任职公告                       | 中国证监会规定媒介 | 2024-09-03 |
| 22 | 天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告                 | 中国证监会规定媒介 | 2024-09-03 |
| 23 | 天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金2024年第3季度报告             | 中国证监会规定媒介 | 2024-10-25 |
| 24 | 天弘基金管理有限公司关于基金经理助理的任职公告                       | 中国证监会规定媒介 | 2024-10-26 |
| 25 | 天弘基金管理有限公司关于董事长变更的公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2024-11-15 |
| 26 | 天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                       | 中国证监会规定媒介 | 2024-12-26 |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金基金合同
- 3、天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金托管协议
- 4、天弘安康颐享12个月持有期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

### 13.2 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

### 13.3 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  
二〇二五年三月三十一日