

天弘安康颐养混合型证券投资基金

2022年第4季度报告

2022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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2023年01月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年01月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年10月01日起至2022年12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 天弘安康颐养混合 |
| 基金主代码 | 420009 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年11月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,428,301,214.62份 |
| 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养老理财工具。 |
| 投资策略 | 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、权证投资策略、存托凭证投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率（税后）+0.75%，即中国人民银行公布并执行的三年期金融机构人民币存款基准利率(税后)+0.75%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券投资为主的混合型基金，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。 |
| 基金管理人 | 天弘基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

| | | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 下属分级基金的基金简称 | 天弘安康颐养混合A | 天弘安康颐养混合C | 天弘安康颐养混合E |
| 下属分级基金的交易代码 | 420009 | 009308 | 013938 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 673,708,943.55份 | 542,726,349.66份 | 211,865,921.41份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2022年10月01日 - 2022年12月31日) | | |
|----------------|--------------------------------|----------------|----------------|
| | 天弘安康颐养混合A | 天弘安康颐养混合C | 天弘安康颐养混合E |
| 1.本期已实现收益 | -4,714,930.86 | -3,161,155.98 | -397,114.17 |
| 2.本期利润 | -12,215,385.48 | -7,737,074.46 | -1,428,320.60 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0171 | -0.0106 | -0.0077 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,362,542,768.08 | 625,218,109.96 | 210,690,009.12 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.0225 | 1.1520 | 0.9944 |

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。

3.2 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

天弘安康颐养混合A净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.82% | 0.15% | 0.65% | 0.01% | -1.47% | 0.14% |
| 过去六个月 | -1.71% | 0.14% | 1.30% | 0.01% | -3.01% | 0.13% |

| | | | | | | |
|--------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去一年 | -2.91% | 0.20% | 2.62% | 0.01% | -5.53% | 0.19% |
| 过去三年 | 19.82% | 0.23% | 8.29% | 0.01% | 11.53% | 0.22% |
| 过去五年 | 35.37% | 0.22% | 14.62% | 0.01% | 20.75% | 0.21% |
| 自基金合同生效日起至至今 | 102.25% | 0.22% | 39.14% | 0.01% | 63.11% | 0.21% |

天弘安康颐养混合C净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.88% | 0.15% | 0.82% | 0.01% | -1.70% | 0.14% |
| 过去六个月 | -1.81% | 0.14% | 1.66% | 0.01% | -3.47% | 0.13% |
| 过去一年 | -3.11% | 0.20% | 3.35% | 0.01% | -6.46% | 0.19% |
| 自基金份额首次确认日起至至今 | 15.20% | 0.22% | 9.63% | 0.01% | 5.57% | 0.21% |

天弘安康颐养混合E净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.84% | 0.15% | 0.87% | 0.01% | -1.71% | 0.14% |
| 过去六个月 | -1.71% | 0.14% | 1.75% | 0.01% | -3.46% | 0.13% |
| 过去一年 | -2.91% | 0.20% | 3.53% | 0.01% | -6.44% | 0.19% |
| 自基金份额首次确认日起至至今 | -0.56% | 0.20% | 4.10% | 0.01% | -4.66% | 0.19% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

天弘安康颐养混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年11月28日-2022年12月31日)



天弘安康颐养混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年04月15日-2022年12月31日)



天弘安康颐养混合E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同于2012年11月28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、本基金自2020年04月14日起增设天弘安康颐养混合C基金份额。天弘安康颐养混合C基金份额的首次确认日为2020年04月15日。本基金自2021年10月20日起增设天弘安康颐养混合E基金份额。天弘安康颐养混合E基金份额的首次确认日为2021年11月05日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王昌俊 | 本基金基金经理 | 2021年11月 | - | 15年 | 男，数学硕士。历任安信证券股份有限公司固定收益分析师、光大永明人寿保险有限公司高级投资经理、光大永明资产管理股份有限公司投资管理总部董事总经理、先锋基金管理有限公司固定收益总监。2017年7月加盟本公司。 |
| 王华 | 本基金基金经 | 2021年09 | - | 12年 | 男，金融学专业硕士。历任招商基金管理有限公司风险管理部资深经理、 |

| | | | | | |
|-----|---|----------|---|-----|--|
| | 理 | 月 | | | 深圳睿泉毅信投资管理有限公司研究部高级研究员、招商基金管理有限公司研究部研究员、投资管理一部基金经理助理、投资经理，2021年2月加盟本公司，历任基金经理助理。 |
| 姜晓丽 | 固定收益业务总监、本基金基金经理，兼任固定收益部、宏观研究部、混合资产部总经理 | 2013年01月 | - | 13年 | 女，经济学硕士。历任本公司债券研究员兼债券交易员、光大永明人寿保险有限公司债券研究员兼交易员。2011年8月加盟本公司，历任固定收益研究员、基金经理助理等。 |

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年四季度，A股市场经历了小幅的震荡，经济基本面呈现继续下行探底的过程，利率小幅上升，但整体流动性依然保持宽松。海外市场同样表现震荡，科技股出现大幅回调，美债加息压力未有缓解迹象。本基金调整了持仓风格，回避过热成长板块，超配价值风格，主要围绕困境反转的行业进行超配，例如地产和出行消费。

展望未来，外部风险将边际改善，例如欧洲的地缘局势，美联储加息的担忧也将逐步弱化。国内的经济将筑底复苏持续改善，流动性依然保持宽松，政策在稳增长方面的利好持续释放，市场的风险偏好将得到逐步提升。从投资角度，我们对市场保持更加积极乐观。内需复苏是未来比较清晰的方向，从预期的修复到基本面兑现，本产品将依然超配困境反转和部分行业格局持续优化的板块，例如地产链、消费板块的超配，以及在新能源板块的配置。2022年四季度，债券市场发生了较大的波动，我们认为主要是有两方面的原因，一是我们在前期定期报告中提及的基础货币投放机制变化所引起的金融机构对基础货币的预防性需求增加所导致的货币市场波动性上升，二是疫情防控思路变化下货币政策的基调由极度宽松向宽松的转变，这两方面原因导致利率中枢和利差水平都有所上移，并且在上移的过程中都出现了超调，超调的出现与部分金融产品的净值下跌、赎回、卖债的负反馈循环有较大的关系。由于我们在三季度时已经对货币市场的波动性有所警惕，因此系统性的降低了组合久期，同时我们认为利差水平偏低，波动性上升的情况下各项利差都将有所修复，因此在整体配置上更偏向于短期高等级信用债（这在第三季度的定期报告中有所提及），因此在市场波动过程中所受到的影响相对较小。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2022年12月31日，天弘安康颐养混合A基金份额净值为2.0225元，天弘安康颐养混合C基金份额净值为1.1520元，天弘安康颐养混合E基金份额净值为0.9944元。报告期内份额净值增长率天弘安康颐养混合A为-0.82%，同期业绩比较基准增长率为0.65%；天弘安康颐养混合C为-0.88%，同期业绩比较基准增长率为0.82%；天弘安康颐养混合E为-0.84%，同期业绩比较基准增长率为0.87%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-----------------------|------------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 253,884,219.43 | 8.74 |
| | 其中：股票 | 253,884,219.43 | 8.74 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,575,306,585.69 | 88.61 |
| | 其中：债券 | 2,575,306,585.69 | 88.61 |
| | 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 | 36,752,252.11 | 1.26 |
| 8 | 其他资产 | 40,285,187.75 | 1.39 |
| 9 | 合计 | 2,906,228,244.98 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 22,895,000.00 | 1.04 |
| C | 制造业 | 157,972,948.70 | 7.19 |
| D | 电力、热力、燃气及水生 生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 10,361,292.00 | 0.47 |
| F | 批发和零售业 | 12,948,304.00 | 0.59 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 14,062,869.00 | 0.64 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术 服务业 | 314,167.25 | 0.01 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 35,166,089.00 | 1.60 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 12,998.08 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 38,283.70 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 106,663.20 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,604.50 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 253,884,219.43 | 11.55 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 002508 | 老板电器 | 889,100 | 24,681,416.00 | 1.12 |
| 2 | 000002 | 万科A | 1,330,160 | 24,208,912.00 | 1.10 |
| 3 | 601899 | 紫金矿业 | 2,289,500 | 22,895,000.00 | 1.04 |
| 4 | 603816 | 顾家家居 | 502,900 | 21,478,859.00 | 0.98 |
| 5 | 600426 | 华鲁恒升 | 463,400 | 15,361,710.00 | 0.70 |
| 6 | 600004 | 白云机场 | 936,900 | 14,062,869.00 | 0.64 |
| 7 | 601689 | 拓普集团 | 223,900 | 13,116,062.00 | 0.60 |
| 8 | 603605 | 珀莱雅 | 75,200 | 12,594,496.00 | 0.57 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 7,200 | 12,434,400.00 | 0.57 |
| 10 | 600079 | 人福医药 | 487,500 | 11,646,375.00 | 0.53 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 5,780,327.82 | 0.26 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 711,316,594.52 | 32.36 |

| | | | |
|----|-----------|------------------|--------|
| | 其中：政策性金融债 | 711,316,594.52 | 32.36 |
| 4 | 企业债券 | 1,698,303,661.93 | 77.25 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 159,906,001.42 | 7.27 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,575,306,585.69 | 117.14 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 210203 | 21国开03 | 2,500,000 | 261,946,232.88 | 11.92 |
| 2 | 190204 | 19国开04 | 2,000,000 | 212,370,794.52 | 9.66 |
| 3 | 150218 | 15国开18 | 1,000,000 | 104,177,863.01 | 4.74 |
| 4 | 188808 | 21沪盛02 | 1,000,000 | 100,705,068.49 | 4.58 |
| 5 | 210312 | 21进出12 | 800,000 | 82,144,241.10 | 3.74 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【国家开发银行】于2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【中国进出口银行】于2022年03

月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报。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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 221,939.58 |
| 2 | 应收证券清算款 | 39,402,737.97 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 660,510.20 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 40,285,187.75 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1 | 113057 | 中银转债 | 11,885,986.51 | 0.54 |
| 2 | 110047 | 山鹰转债 | 10,246,511.83 | 0.47 |
| 3 | 127045 | 牧原转债 | 9,599,590.84 | 0.44 |
| 4 | 113648 | 巨星转债 | 9,230,005.37 | 0.42 |
| 5 | 113535 | 大业转债 | 8,923,492.89 | 0.41 |
| 6 | 127060 | 湘佳转债 | 8,245,176.68 | 0.38 |
| 7 | 128081 | 海亮转债 | 7,872,396.24 | 0.36 |
| 8 | 127049 | 希望转2 | 7,793,282.19 | 0.35 |
| 9 | 113042 | 上银转债 | 7,762,496.06 | 0.35 |
| 10 | 110053 | 苏银转债 | 7,482,406.65 | 0.34 |
| 11 | 128121 | 宏川转债 | 7,313,893.15 | 0.33 |
| 12 | 110079 | 杭银转债 | 6,261,056.76 | 0.28 |
| 13 | 127022 | 恒逸转债 | 5,758,269.11 | 0.26 |
| 14 | 110075 | 南航转债 | 5,380,103.01 | 0.24 |
| 15 | 123107 | 温氏转债 | 5,300,411.31 | 0.24 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 16 | 110077 | 洪城转债 | 4,899,409.32 | 0.22 |
| 17 | 113033 | 利群转债 | 3,464,249.64 | 0.16 |
| 18 | 123100 | 朗科转债 | 3,269,661.37 | 0.15 |
| 19 | 113530 | 大丰转债 | 3,059,815.58 | 0.14 |
| 20 | 123089 | 九洲转2 | 2,503,889.95 | 0.11 |
| 21 | 110063 | 鹰19转债 | 2,246,657.48 | 0.10 |
| 22 | 113591 | 胜达转债 | 2,217,522.44 | 0.10 |
| 23 | 111002 | 特纸转债 | 2,199,950.71 | 0.10 |
| 24 | 127018 | 本钢转债 | 2,096,667.12 | 0.10 |
| 25 | 123106 | 正丹转债 | 2,000,638.14 | 0.09 |
| 26 | 123082 | 北陆转债 | 1,961,051.60 | 0.09 |
| 27 | 128108 | 蓝帆转债 | 1,800,140.55 | 0.08 |
| 28 | 128133 | 奇正转债 | 1,686,260.24 | 0.08 |
| 29 | 113608 | 威派转债 | 1,677,338.82 | 0.08 |
| 30 | 113606 | 荣泰转债 | 1,540,368.58 | 0.07 |
| 31 | 110064 | 建工转债 | 1,361,707.79 | 0.06 |
| 32 | 113628 | 晨丰转债 | 1,080,475.79 | 0.05 |
| 33 | 123004 | 铁汉转债 | 1,006,654.93 | 0.05 |
| 34 | 123085 | 万顺转2 | 661,300.45 | 0.03 |
| 35 | 128075 | 远东转债 | 114,398.77 | 0.01 |
| 36 | 128140 | 润建转债 | 1,615.85 | 0.00 |
| 37 | 113049 | 长汽转债 | 1,147.70 | 0.00 |

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 天弘安康颐养混合 A | 天弘安康颐养混合 C | 天弘安康颐养混合 E |
|-------------|----------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 740,856,163.83 | 851,483,535.07 | 101,476,307.32 |

| | | | |
|---------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 报告期期间基金总申购份额 | 8,819,829.17 | 33,383,866.54 | 160,067,884.07 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 75,967,049.45 | 342,141,051.95 | 49,678,269.98 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 673,708,943.55 | 542,726,349.66 | 211,865,921.41 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | 天弘安康颐养混合A | 天弘安康颐养混合C | 天弘安康颐养混合E |
|--------------------------|---------------|-----------|----------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 90,771,558.25 | - | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - | 160,014,124.91 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 90,771,558.25 | - | 160,014,124.91 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 13.47 | - | 75.53 |

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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额（份） | 交易金额（元） | 适用费率 |
|----|------|------------|----------------|----------------|--------|
| 1 | 申购 | 2022-10-14 | 79,760,717.85 | 80,000,000.00 | 0.0000 |
| 2 | 申购 | 2022-10-25 | 40,016,006.40 | 40,000,000.00 | 0.0000 |
| 3 | 申购 | 2022-11-17 | 40,237,400.66 | 40,000,000.00 | 0.0000 |
| 合计 | | | 160,014,124.91 | 160,000,000.00 | |

注：基金管理人在本报告期内关于本基金的交易委托天弘基金直销中心办理，根据本基金法律文件及相关法规，依照适用费率收取交易费用，其中适用费率保留至小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定，调整了本基金A类基金份额在基金销售机构及直销机构的单笔最低追加申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额，并于2022年11月23日生效。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调整旗下部分基金在基金销售机构及直销机构的单笔最低追加申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额的公告》。

在本报告截止日至报告批准送出日之间，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定，调整了本基金在基金销售机构及直销机构的单笔最低申购金额、单笔最低追加申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额，并于2023年1月17日生效。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调整旗下部分基金在基金销售机构及直销机构的单笔最低申购金额、单笔最低追加申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘安康养老混合型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘安康颐养混合型证券投资基金基金合同
- 3、天弘安康颐养混合型证券投资基金托管协议
- 4、天弘安康颐养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

9.2 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

9.3 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

天弘基金管理有限公司
二〇二三年一月二十八日