

天弘安康颐养混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年01月01日起至2020年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	20
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘安康颐养混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	538,870,059.47份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘安康颐养混合A	天弘安康颐养混合C
下属分级基金的交易代码	420009	009308
报告期末下属分级基金的份额总额	446,102,353.13份	92,767,706.34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养老理财工具。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略，通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益，并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报，在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上，力争实现基金资产的持续稳定增值。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（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。

注：本基金自2015年4月14日起，业绩比较基准由“五年期银行定期存款利率（税后）”，变更为“三年期银行定期存款利率（税后）+0.75%”。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	郭明
	联系电话	022-83310208	010-66105799
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95046	95588
传真		022-83865569	010-66105798
注册地址		天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	北京市西城区复兴门内大街55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55号
邮政编码		300203	100140
法定代表人		胡晓明	陈四清

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年01月01日-2020年06月30日)	
	天弘安康颐养混合A	天弘安康颐养混合C
本期已实现收益	48,687,404.44	610,887.16
本期利润	31,602,556.14	280,382.67
加权平均基金份额本期利润	0.0696	0.0133
本期加权平均净值利润率	4.01%	1.32%
本期基金份额净值增长率	4.21%	0.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
期末可供分配利润	320,373,045.03	636,482.83
期末可供分配基金份额利润	0.7182	0.0069
期末基金资产净值	784,748,228.58	93,404,189.17
期末基金份额净值	1.759	1.007
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	75.90%	0.70%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、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，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.40%	0.19%	0.24%	0.01%	0.16%	0.18%
过去三个月	1.79%	0.17%	0.68%	0.01%	1.11%	0.16%
过去六个月	4.21%	0.27%	1.38%	0.01%	2.83%	0.26%
过去一年	11.26%	0.25%	2.81%	0.01%	8.45%	0.24%
过去三年	19.09%	0.20%	8.91%	0.01%	10.18%	0.19%
自基金合同 生效日起至 今	75.90%	0.23%	30.26%	0.01%	45.64%	0.22%

天弘安康颐养混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.40%	0.20%	0.31%	0.01%	0.09%	0.19%
自基金份额 首次确认日 起至今	0.70%	0.17%	0.75%	0.01%	-0.05%	0.16%

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-2020年06月30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-2020年06月30日)



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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立。注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、天津、深圳、四川设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

注：2020年7月22日，公司披露了《天弘基金管理有限公司关于股东名称变更的公告》。

截至2020年6月30日，本基金管理人共管理74只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘文化新兴产业股票型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康颐养混合型证券投资基金、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金（LOF）、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘中证500指数型发起式证券投资基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘医疗健康混合型证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数增强型证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基

金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原天弘中证电子指数型发起式证券投资基金）、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原天弘中证计算机主题指数型发起式证券投资基金）、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘优选债券型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘悦享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金、天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金、天弘港股通精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘增强回报债券型证券投资基金、天弘安益债券型证券投资基金、天弘华享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘弘择短债债券型证券投资基金、天弘信益债券型证券投资基金、天弘养老目标日期2035三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘弘新混合型发起式证券投资基金、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金、天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）、天弘优质成长企业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘鑫利三年定期开放债券型证券投资基金、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金、天弘季季兴三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金、天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金、天弘越南市场股票型发起式证券投资基金（QDII）、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘增利短债债券型发起式证券投资基金、天弘恒享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘纯享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中债1-3年国开行债券指数发起式证券投资基金、天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、天弘兴享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中证中美互联网指数型发起式证券投资基金（QDII）、天弘中债3-5年政策性金融债指数发起式证券投资基金、天弘成享一年定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

姜晓丽	本基金基金经理。	2013年01月	-	11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。
钱文成	本基金基金经理。	2014年01月	2020年06月	14年	男，理学硕士。2007年5月加盟本公司，历任本公司行业研究员、高级研究员、策略研究员、研究主管助理、研究部副主管、研究副总监、研究总监、股票投资部副总经理、基金经理助理等。
田俊维	本基金基金经理。	2020年06月	-	10年	男，理学及经济学双学士。历任申银万国证券研究所传媒与互联网行业研究员，安信证券股份有限公司传媒与互联网行业研究员。2013年6月加盟本公司，历任TMT行业研究员等。
赵鼎龙	本基金基金经理助理。	2018年11月	-	5年	男，电子学硕士。历任泰康资产管理有限责任公司固收交易员。2017年8月加盟本公司，历任固定收益机构投资部研究员、投资经理助理、基金经理助理。
杜广	本基金基金经理助理。	2019年12月	-	6年	男，金融数学硕士。历任泰康资产管理有限责任公司债券研究员，中国人寿养老保险股份有限公司债券研究员。2017年7月加盟

					本公司，历任投资经理助理、基金经理助理。
彭玮	本基金基金经理助理。	2019 年12 月	-	3 年	男，金融学硕士。历任渤海证券股份有限公司债券销售交易总部交易助理，渤海汇金证券资产管理有限公司固定收益部投资经理助理，2019年7月加盟本公司。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价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19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

上半年，疫情作为黑天鹅事件将经济的周期性运行完全打乱，成为主导Q1和Q2的主要矛盾，宏观经济走出深V，货币政策快速放松和收紧成为金融市场大幅波动的重要原因之一，债券市场由牛转熊大幅波动，股票市场则在疫情之后逐渐修复对经济的悲观预期。

在1月20日，我们观察到疫情黑天鹅突发，进行了战术性应对，执行加仓利率债、减持权益类资产操作，整个组合久期提升到2-3年，到了2月20日前后，又观察到疫情的全球扩散不可避免，外围金融市场非常脆弱，我们认为在此阶段疫情在投资中的重要性升级为战略性决定因素，保持组合久期在2年以上，同时进一步继续减持权益类资产仓位以防控风险。进入4月，国内央行释放超预期宽松信号，外围市场剧烈调整、风险已经释放，我们观测到国内建筑业景气度迅速提升、信贷条件非常正面，债券市场交易拥挤度提升，各类利差被压平，我们认为宏观状态和市场状态的矛盾不可持续，因此我们对债券的谨慎程度与日俱增，维持了短久期的基础配置，对长债的波动操作也更加谨慎，整个组合久期保持在2-3年，同时对权益则修正为谨慎乐观，执行了防守反击的策略，加仓部分低估值、景气度改善资产，希望在风险可控条件下获取收益。5-6月，宏观经济V型复苏，货币政策做出重大调整，修正了流动性管理部门的过度宽松预期，触发了债券市场整体大幅上行，市场一度出现基金赎回潮、银行体系出现流动性风险、资产负债风险，而我们在5月观察到市场运行逻辑发生根本改变之时，就对债券观点修正为谨慎，于5月中下旬完成了债券仓位的久期收缩操作，将组合久期控制在1年以内，较为有效地规避了6月更大级别的债券市场调整，而权益市场从3月下旬之后持续上涨，但内部风格分化严重，我们持有的周期类的股票整体滞涨，在正股持续分化的情况下，我们持有的低价类转债也出现了持续下跌，因此从5月开始纯债、转债、周期类股票三类资产表现均不好，所以组合整体出现了一定的回撤，而站在6月的时点，我们判断宏观经济向上的方向已经确立，部分权益类资产也已经跌出极强的配置价值，因此在6月中旬选择了加仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2020年06月30日，天弘安康颐养混合A基金份额净值为1.759元，天弘安康颐养混合C基金份额净值为1.007元。报告期内份额净值增长率天弘安康颐养混合A为4.21%，同期业绩比较基准增长率为1.38%；天弘安康颐养混合C为0.70%，同期业绩比较基准增长率为0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来，经济复苏的预期进一步加强，货币政策也会根据经济复苏的节奏灵活调整，我们认为金融市场目前处于流动性偏紧的阶段，但信用条件整体已经实际宽松，宏观环境对经济周期性恢复增长较为有利。因此，在资产战略性排序上，我们认为股票好于转债好于债券，对股票适度积极。在股票的投资上，我们继续坚持以周期股为主的思路，尤其是自下而上选择一些估值已经偏低的周期成长股，应是非常优质的投资标的；随着可转债估值的修复、配置价值和边际安全开始出现，我们将会再次提高可转债仓位至较高配置水平；债券整体偏向谨慎，估值性价比极低，因此保持偏低久期，择机进行波段交易。最后，外部环境因素不可测性较大，但短期内确实会对组合形成极大影响，因此我们将会择机应对，灵活应变，但不改变我们的战略选择。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、基金会计、风险管理人员及内控合规人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模

型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对天弘安康颐养混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全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，天弘安康颐养混合型证券投资基金的管理人——天弘基金管理有限公司在天弘安康颐养混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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。本报告期内，天弘安康颐养混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘安康颐养混合型证券投资基金2020年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：天弘安康颐养混合型证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	12,987,425.48	21,465,915.26
结算备付金		24,455,004.55	8,308,461.80
存出保证金		35,462.40	30,842.67
交易性金融资产	6.4.7.2	946,682,959.12	982,733,615.22
其中: 股票投资		116,114,290.02	100,658,747.44
基金投资		-	-
债券投资		815,570,049.92	882,074,867.78
资产支持证券投资		14,998,619.18	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,104,899.09	-
应收利息	6.4.7.5	12,955,459.68	16,967,706.07
应收股利		-	-
应收申购款		4,855,457.84	612,451.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,004,076,668.16	1,030,118,992.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		114,300,000.00	253,349,711.57
应付证券清算款		4,231,964.71	20,626,309.13
应付赎回款		6,392,514.97	2,978,634.47

应付管理人报酬		624,165.37	571,900.27
应付托管费		138,703.40	127,088.94
应付销售服务费		8,551.56	-
应付交易费用	6.4.7.7	31,016.51	23,787.44
应交税费		88,855.32	77,314.04
应付利息		-	175,048.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	108,478.57	189,000.00
负债合计		125,924,250.41	278,118,794.06
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	538,870,059.47	445,568,845.99
未分配利润	6.4.7.10	339,282,358.28	306,431,352.24
所有者权益合计		878,152,417.75	752,000,198.23
负债和所有者权益总计		1,004,076,668.16	1,030,118,992.29

注：报告截止日2020年06月30日，天弘安康颐养混合型证券投资基金A类基金份额净值1.759元，天弘安康颐养混合型证券投资基金C类基金份额净值1.007元；基金份额总额538,870,059.47份，其中天弘安康颐养混合型证券投资基金A类基金份额446,102,353.13份，天弘安康颐养混合型证券投资基金C类基金份额92,767,706.34份。

6.2 利润表

会计主体：天弘安康颐养混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年06月30日
一、收入		38,826,732.16	33,759,924.33
1. 利息收入		18,024,452.32	19,747,363.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	195,653.20	130,234.62
债券利息收入		17,798,774.40	19,590,254.88

资产支持证券利息收入		1,340.60	-
买入返售金融资产收入		28,684.12	26,874.35
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		36,941,625.84	691,633.06
其中：股票投资收益	6.4.7.12	19,571,539.79	-3,610,748.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	16,201,026.84	3,648,117.75
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,169,059.21	654,263.70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-17,415,352.79	12,389,143.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,276,006.79	931,784.14
减：二、费用		6,943,793.35	6,802,489.35
1. 管理人报酬		3,566,567.72	3,703,894.63
2. 托管费		792,570.64	823,087.68
3. 销售服务费		9,857.26	-
4. 交易费用	6.4.7.18	161,613.41	136,849.08
5. 利息支出		2,233,175.50	1,965,914.06
其中：卖出回购金融资产 支出		2,233,175.50	1,965,914.06
6. 税金及附加		54,560.46	55,582.47
7. 其他费用	6.4.7.19	125,448.36	117,161.43

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,882,938.81	26,957,434.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,882,938.81	26,957,434.98

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘安康颐养混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	445,568,845.99	306,431,352.24	752,000,198.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,882,938.81	31,882,938.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	93,301,213.48	968,067.23	94,269,280.71
其中：1. 基金申购款	198,707,115.70	74,081,722.74	272,788,838.44
2. 基金赎回款	-105,405,902.22	-73,113,655.51	-178,519,557.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	538,870,059.47	339,282,358.28	878,152,417.75
项 目	上年度可比期间		

	2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	529,643,676.85	279,161,573.77	808,805,250.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,957,434.98	26,957,434.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-89,230,078.45	-50,431,932.26	-139,662,010.71
其中：1. 基金申购款	70,410,278.25	39,436,398.43	109,846,676.68
2. 基金赎回款	-159,640,356.70	-89,868,330.69	-249,508,687.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	440,413,598.40	255,687,076.49	696,100,674.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘安康颐养混合型证券投资基金(原名为“天弘安康养老混合型证券投资基金”，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1064号《关于核准天弘安康养老混合型证券投资基金募集的批复》核准，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘安康养老混合型证

券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集329,475,073.08元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第466号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘安康养老混合型证券投资基金基金合同》于2012年11月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为329,530,789.56份基金份额，其中认购资金利息折合55,716.48份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《天弘基金管理有限公司关于变更天弘安康养老混合型证券投资基金名称并修改基金合同等法律文件的公告》，天弘安康养老混合型证券投资基金于2018年5月10日起更名为天弘安康颐养混合型证券投资基金。

根据基金管理人天弘基金管理有限公司2020年4月14日《天弘安康颐养混合型证券投资基金增设份额并相应修改相关法律文件的公告》的有关规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自2020年4月14日起对本基金增加天弘安康颐养混合型证券投资基金C类基金份额(以下简称“C类基金”)，原基金份额转为A类基金份额，并相应修改基金合同。A类基金份额在投资者认购/申购、赎回基金时收取认购/申购、赎回费用，而不计提销售服务费；C类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用，同时从本类别基金资产中计提销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘安康颐养混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括：依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例为0-30%，其中，投资于精选的价值型股票的比例不低于股票投资部分的80%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%；债券等固定收益类金融工具投资占基金资产的比例不低于70%，其中，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款利率(税后)+0.75%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、

《天弘安康颐养混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2020年06月30日的财务状况以及2020年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提

供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
活期存款	12,987,425.48
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
合计	12,987,425.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		109,612,951.75	116,114,290.02	6,501,338.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	512,380,457.51	507,965,049.92	-4,415,407.59
	银行间市场	307,370,016.46	307,605,000.00	234,983.54
	合计	819,750,473.97	815,570,049.92	-4,180,424.05
资产支持证券		14,998,619.18	14,998,619.18	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		944,362,044.90	946,682,959.12	2,320,914.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	1,609.89
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	11,004.80

应收债券利息	12,940,067.45
应收资产支持证券利息	2,761.64
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	15.90
合计	12,955,459.68

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	20,181.39
银行间市场应付交易费用	10,835.12
合计	31,016.51

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	24.67
应付证券出借违约金	—
预提费用	108,453.90
合计	108,478.57

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 天弘安康颐养混合A

金额单位：人民币元

项目 (天弘安康颐养混合A)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	445,568,845.99	445,568,845.99
本期申购	100,735,227.60	100,735,227.60
本期赎回（以“-”号填列）	-100,201,720.46	-100,201,720.46
本期末	446,102,353.13	446,102,353.13

6.4.7.9.2 天弘安康颐养混合C

金额单位：人民币元

项目 (天弘安康颐养混合C)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	97,971,888.10	97,971,888.10
本期赎回（以“-”号填列）	-5,204,181.76	-5,204,181.76
本期末	92,767,706.34	92,767,706.34

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 天弘安康颐养混合A

单位：人民币元

项目 (天弘安康颐养混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	272,058,695.18	34,372,657.06	306,431,352.24
本期利润	48,687,404.44	-17,084,848.30	31,602,556.14
本期基金份额交易产生的变动数	-373,054.59	985,021.66	611,967.07
其中：基金申购款	67,109,005.90	6,598,119.79	73,707,125.69
基金赎回款	-67,482,060.49	-5,613,098.13	-73,095,158.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	320,373,045.03	18,272,830.42	338,645,875.45

6.4.7.10.2 天弘安康颐养混合C

单位：人民币元

项目 (天弘安康颐养混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	610,887.16	-330,504.49	280,382.67
本期基金份额交易产生的变动数	1,018,174.49	-662,074.33	356,100.16
其中：基金申购款	1,074,166.03	-699,568.98	374,597.05
基金赎回款	-55,991.54	37,494.65	-18,496.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,629,061.65	-992,578.82	636,482.83

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	46,349.67
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	149,043.29
其他	260.24
合计	195,653.20

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	36,797,340.07
减：卖出股票成本总额	17,225,800.28
买卖股票差价收入	19,571,539.79

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	16,201,026.84
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	16,201,026.84

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,381,574,422.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,341,678,743.29
减：应收利息总额	23,694,651.93
买卖债券差价收入	16,201,026.84

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,169,059.21
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	1,169,059.21

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	-17,415,352.79
——股票投资	-5,512,200.64
——债券投资	-11,903,152.15
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	-17,415,352.79

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	1,245,241.22

基金转换费收入	30,765.57
合计	1,276,006.79

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	144,288.41
银行间市场交易费用	17,325.00
合计	161,613.41

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	7,394.46
银行间账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	125,448.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至202 0年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至201 9年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,566,567.72	3,703,894.63
其中：支付销售机构的客户维护费	802,830.76	715,994.24

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0.90%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及基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	792,570.64	823,087.68

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘安康颐养混合A	天弘安康颐养混合C	合计
天弘基金 管理有限公司	-	1,142.79	1,142.79
合计	-	1,142.79	1,142.79
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘安康颐养混合A	天弘安康颐养混合C	合计
天弘基金 管理有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

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。天弘安康颐养混合C按0.20%计提销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘安康颐养混合A不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期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。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

天弘安康颐养混合A

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至 2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年06月30日
报告期初持有的基金份额	90,771,558.25	90,771,558.25
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	90,771,558.25	90,771,558.25
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	20.35%	20.61%

天弘安康颐养混合C

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至 2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

天弘安康颐养混合A

关联方名称	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
天弘创新资产管理有限公司	60,331,825.04	13.52%	60,331,825.04	13.54%

注：1、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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

6.4.10.6 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 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	12,987,425.48	46,349.67	2,056,297.37	38,218.13

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601816	京沪高铁	2020-01-08	2020-07-16	新股锁定	4.88	6.17	906,536	4,423,895.68	5,593,327.12	-
688520	神州细胞	2020-06-11	2020-12-22	科创板打新限售	25.64	58.82	12,351	316,679.64	726,485.82	-

688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688516	奥特维	2020-05-14	2020-11-23	科创板打新限售	23.28	43.10	3,440	80,083.20	148,264.00	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：资产支持证券										
证券	证券	成功	可流	流通	认购	期末	数量	期末	期末	备注

代码	名称	认购日	通日	受限类型	价格	估值单价	(单位:张)	成本总额	估值总额	
168733	申程01优	2020-06-29	2020-07-14	资产支持证券未上市	99.99	99.99	150,000	14,998,619.18	14,998,619.18	-

注：根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额114,300,000.00元，于2020年07月01日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为主动投资的混合型基金，其风险收益预期高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及短期金融工具等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流

动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取在严格控制风险的前提下，谋求实现基金财产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门；讨论、协调各部门之间的风险管理过程；听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点，并调整与改进相关的风险处理和控制策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	120,322,000.00	100,186,000.00
合计	120,322,000.00	100,186,000.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	353,437,897.50	395,467,547.07
AAA以下	341,810,152.42	365,579,320.71
未评级	-	20,842,000.00
合计	695,248,049.92	781,888,867.78

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	14,998,619.18	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	14,998,619.18	-

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2020年06月30日，除卖出回购金融资产款余额中有114,300,000.00元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度，根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,987,425.48	-	-	-	12,987,425.48
结算备付金	24,455,004.55	-	-	-	24,455,004.55
存出保证金	35,462.40	-	-	-	35,462.40
交易性金融资产	225,155,925.98	476,693,678.73	128,719,064.39	116,114,290.02	946,682,959.12
应收证券清算款	-	-	-	2,104,899.09	2,104,899.09
应收利息	-	-	-	12,955,459.68	12,955,459.68
应收申购款	-	-	-	4,855,457.84	4,855,457.84
资产总计	262,633,818.41	476,693,678.73	128,719,064.39	136,030,106.63	1,004,076,668.16
负债					
卖出回购金融资产款	114,300,000.00	-	-	-	114,300,000.00
应付证券清算款	-	-	-	4,231,964.71	4,231,964.71
应付赎回款	-	-	-	6,392,514.97	6,392,514.97
应付管理人报酬	-	-	-	624,165.37	624,165.37
应付托管费	-	-	-	138,703.40	138,703.40
应付销售服务费	-	-	-	8,551.56	8,551.56
应付交易费用	-	-	-	31,016.51	31,016.51
应交税费	-	-	-	88,855.32	88,855.32
其他负债	-	-	-	108,478.57	108,478.57
负债总计	114,300,000.00	-	-	11,624,250.41	125,924,250.41
利率敏感度缺口	148,333,818.41	476,693,678.73	128,719,064.39	124,405,856.22	878,152,417.75
上年度末2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	21,465,915.26	-	-	-	21,465,915.26
结算备付金	8,308,461.80	-	-	-	8,308,461.80
存出保证金	30,842.67	-	-	-	30,842.67
交易性金融资产	154,360,900.00	643,359,186.25	84,354,781.53	100,658,747.44	982,733,615.22
应收利息	-	-	-	16,967,706.07	16,967,706.07
应收申购款	-	-	-	612,451.27	612,451.27
资产总计	184,166,119.73	643,359,186.25	84,354,781.53	118,238,904.78	1,030,118,992.29
负债					
卖出回购金融资产款	253,349,711.57	-	-	-	253,349,711.57
应付证券清算款	-	-	-	20,626,309.13	20,626,309.13
应付赎回款	-	-	-	2,978,634.47	2,978,634.47
应付管理人报酬	-	-	-	571,900.27	571,900.27
应付托管费	-	-	-	127,088.94	127,088.94
应付交易费用	-	-	-	23,787.44	23,787.44
应交税费	-	-	-	77,314.04	77,314.04
应付利息	-	-	-	175,048.20	175,048.20
其他负债	-	-	-	189,000.00	189,000.00
负债总计	253,349,711.57	-	-	24,769,082.49	278,118,794.06
利率敏感度缺口	-69,183,591.84	643,359,186.25	84,354,781.53	93,469,822.29	752,000,198.23

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	市场利率下降25个基点	4,139,467.65	4,467,896.53
	市场利率上升25个基点	-4,094,062.11	-4,422,220.70

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为0-30%，其中，投资于精选的价值型股票的比例不低于股票投资部分的 80%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%；债券等固定收益类金融工具投资占基金资产的比例不低于70%，其中，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	116,114,290.02	13.22	100,658,747.44	13.39

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	116,114,290.02	13.22	100,658,747.44	13.39

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2020年06月30日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为13.22%(2019年12月31日：13.39%)，因此其他价格风险对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日：同)。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为293,110,230.34元，属于第二层次的余额为638,574,109.60元，属于第三层次的余额为14,998,619.18元(2019年12月31日：第一层次221,840,883.28元，第二层次760,892,731.94元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根

据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产 资产支持证券投资	合计
2020年1月1日	-	-
购买	14,998,619.18	14,998,619.18
出售	-	-
转入第三层级	-	-
转出第三层级	-	-
当期利得或损失总额	-	-
——计入损益的利得或损失	-	-
2020年6月30日	14,998,619.18	14,998,619.18
2020年6月30日仍持有的资产计入2020年1月1日至2020年6月30日止期间损益的未实现利得或损失的变动(从转入第三层级起算)		
——公允价值变动损益	-	-

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。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	116,114,290.02	11.56

	其中：股票	116,114,290.02	11.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	830,568,669.10	82.72
	其中：债券	815,570,049.92	81.23
	资产支持证券	14,998,619.18	1.49
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	37,442,430.03	3.73
8	其他各项资产	19,951,279.01	1.99
9	合计	1,004,076,668.16	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	70,527,152.56	8.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	55,056.40	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,593,420.57	0.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	190,731.77	0.02
J	金融业	34,669,230.40	3.95
K	房地产业	5,065,932.00	0.58
L	租赁和商务服务业	-	-
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	116,114,290.02	13.22

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	9,400	13,751,072.00	1.57
2	600887	伊利股份	332,621	10,354,491.73	1.18
3	600036	招商银行	291,000	9,812,520.00	1.12
4	002508	老板电器	295,897	9,205,355.67	1.05
5	600690	海尔智家	519,600	9,196,920.00	1.05
6	603899	晨光文具	165,800	9,052,680.00	1.03
7	000333	美的集团	146,400	8,753,256.00	1.00
8	000651	格力电器	149,400	8,451,558.00	0.96
9	601318	中国平安	117,966	8,422,772.40	0.96
10	600030	中信证券	315,800	7,613,938.00	0.87
11	601816	京沪高铁	906,551	5,593,420.57	0.64
12	000002	万 科 A	193,800	5,065,932.00	0.58
13	601939	建设银行	750,000	4,732,500.00	0.54
14	601601	中国太保	150,000	4,087,500.00	0.47
15	688520	神州细胞	12,351	726,485.82	0.08
16	603195	公牛集团	1,359	218,323.35	0.02
17	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.02

18	688516	奥特维	3,440	148,264.00	0.02
19	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
20	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
21	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.01
22	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
23	603317	天味食品	1,676	93,152.08	0.01
24	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
25	002989	中天精装	980	55,056.40	0.01
26	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
27	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
28	300839	N博汇	502	11,751.82	0.00
29	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
30	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
31	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
32	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600690	海尔智家	9,998,603.92	1.33
2	000651	格力电器	8,557,673.00	1.14
3	601816	京沪高铁	6,319,848.88	0.84
4	000333	美的集团	2,567,138.00	0.34
5	688169	石头科技	1,162,291.44	0.15
6	688126	沪硅产业	857,853.92	0.11
7	688177	百奥泰	854,806.68	0.11
8	688158	优刻得	687,861.00	0.09
9	688396	华润微	672,320.00	0.09
10	688318	财富趋势	467,877.96	0.06

11	688106	金宏气体	403,641.00	0.05
12	688598	金博股份	360,844.00	0.05
13	688520	神州细胞	316,679.64	0.04
14	688233	神工股份	256,962.86	0.03
15	688189	南新制药	238,745.02	0.03
16	688051	佳华科技	205,932.93	0.03
17	688505	复旦张江	203,057.60	0.03
18	688086	紫晶存储	201,167.89	0.03
19	688222	成都先导	188,804.52	0.03
20	688085	三友医疗	184,594.72	0.02

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688111	金山办公	3,443,660.41	0.46
2	603899	晨光文具	2,993,848.00	0.40
3	601816	京沪高铁	2,581,581.00	0.34
4	600519	贵州茅台	2,445,639.00	0.33
5	688396	华润微	2,301,964.70	0.31
6	688126	沪硅产业	2,062,323.46	0.27
7	688169	石头科技	2,026,522.87	0.27
8	688177	百奥泰	1,630,325.60	0.22
9	688158	优刻得	1,368,995.24	0.18
10	688106	金宏气体	1,011,362.78	0.13
11	688233	神工股份	971,796.12	0.13
12	688318	财富趋势	932,055.00	0.12
13	688086	紫晶存储	747,994.76	0.10
14	688505	复旦张江	742,205.43	0.10

15	688598	金博股份	715,163.34	0.10
16	688033	天宜上佳	657,130.94	0.09
17	688051	佳华科技	502,530.86	0.07
18	688312	燕麦科技	458,700.00	0.06
19	688186	广大特材	455,334.90	0.06
20	688100	威胜信息	410,130.70	0.05

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	38,193,543.50
卖出股票收入（成交）总额	36,797,340.07

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,036,000.00	4.56
	其中：政策性金融债	40,036,000.00	4.56
4	企业债券	328,024,909.20	37.35
5	企业短期融资券	80,286,000.00	9.14
6	中期票据	183,131,000.00	20.85
7	可转债(可交换债)	184,092,140.72	20.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	815,570,049.92	92.87

注：可转债项下包含可交换债387,148.80元。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	011902838	19云锡股SCP004	600,000	60,336,000.00	6.87
2	101900077	19巨化MTN001	400,000	40,624,000.00	4.63
3	127447	PR宁地铁	500,000	40,140,000.00	4.57
4	200401	20农发01	400,000	40,036,000.00	4.56
5	136773	16清控02	405,000	37,498,950.00	4.27

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	168733	申程01优	150,000	14,998,619.18	1.71

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	35,462.40
2	应收证券清算款	2,104,899.09
3	应收股利	—
4	应收利息	12,955,459.68
5	应收申购款	4,855,457.84
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	19,951,279.01

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128026	众兴转债	17,053,729.44	1.94
2	128085	鸿达转债	12,596,491.21	1.43
3	110058	永鼎转债	12,223,929.30	1.39
4	128013	洪涛转债	6,753,376.30	0.77
5	113528	长城转债	5,703,123.00	0.65
6	128087	孚日转债	5,401,433.12	0.62

7	113541	荣晟转债	5,133,329.50	0.58
8	128042	凯中转债	4,500,317.04	0.51
9	110059	浦发转债	4,351,032.00	0.50
10	110065	淮矿转债	3,294,882.80	0.38
11	113527	维格转债	3,243,067.20	0.37
12	128064	司尔转债	3,173,144.40	0.36
13	113030	东风转债	2,929,382.40	0.33
14	113530	大丰转债	2,680,530.60	0.31
15	113025	明泰转债	2,519,119.20	0.29
16	127003	海印转债	2,191,413.30	0.25
17	128063	未来转债	2,172,200.00	0.25
18	110053	苏银转债	2,118,400.00	0.24
19	110034	九州转债	1,997,788.80	0.23
20	110045	海澜转债	1,935,200.00	0.22
21	128072	翔鹭转债	1,616,395.50	0.18
22	128032	双环转债	1,594,014.80	0.18
23	113012	骆驼转债	1,242,123.70	0.14
24	128082	华锋转债	1,222,660.83	0.14
25	128034	江银转债	1,033,300.00	0.12
26	128065	雅化转债	930,775.00	0.11
27	113549	白电转债	879,036.00	0.10
28	128015	久其转债	760,333.60	0.09
29	113546	迪贝转债	754,150.50	0.09
30	113535	大业转债	581,386.00	0.07
31	128023	亚太转债	433,798.16	0.05
32	123028	清水转债	414,587.10	0.05
33	113029	明阳转债	216,348.30	0.02
34	128084	木森转债	214,252.50	0.02
35	128080	顺丰转债	182,106.00	0.02
36	123023	迪森转债	162,691.40	0.02
37	113024	核建转债	159,079.50	0.02

38	113545	金能转债	158,672.40	0.02
39	128075	远东转债	139,251.80	0.02
40	110061	川投转债	95,540.00	0.01
41	128057	博彦转债	35,110.52	0.00
42	128035	大族转债	749.42	0.00
43	123010	博世转债	533.75	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
天弘 安康 颐养 混合A	749, 594	595.13	184,124,549.84	41.2 7%	261,977,803.29	58.73%
天弘 安康 颐养 混合C	17,0 14	5,452.43	—	—	92,767,706.34	100.0 0%
合计	766, 608	702.93	184,124,549.84	34.1 7%	354,745,509.63	65.83%

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天弘安康颐养混合A	679,344.88	0.15%
	天弘安康颐养混合C	443,913.52	0.48%
	合计	1,123,258.40	0.21%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	天弘安康颐养混合A	0~10
	天弘安康颐养混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘安康颐养混合A	0
	天弘安康颐养混合C	0
	合计	0

§ 9 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
基金合同生效日(2012年11月28日)基金份额总额	329,530,789.56	—

本报告期期初基金份额总额	445,568,845.99	—
本报告期基金总申购份额	100,735,227.60	97,971,888.10
减：本报告期基金总赎回份额	100,201,720.46	5,204,181.76
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	446,102,353.13	92,767,706.34

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经天弘基金管理有限公司股东会2020年第2次会议审议通过，黄浩先生担任公司董事，祖国明先生不再担任公司董事。

本报告期内本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	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	注
安信证券	2	4,945,088.26	8.54%	3,616.40	8.54%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	15,320,484.25	26.45%	11,203.96	26.45%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	8,875,166.94	15.32%	6,490.63	15.32%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	237,696.14	0.41%	173.83	0.41%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	5,683,764.97	9.81%	4,156.60	9.81%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-

证券						
国信 证券	1	—	—	—	—	—
海通 证券	1	1,409,365.15	2.43%	1,030.71	2.43%	—
宏源 证券	1	—	—	—	—	—
华创 证券	1	136,774.84	0.24%	100.03	0.24%	—
华泰 联合 证券	2	—	—	—	—	—
平安 证券	1	—	—	—	—	—
中泰 证券	1	3,988,908.98	6.89%	2,917.09	6.89%	—
瑞银 证券	1	—	—	—	—	—
申万 宏源 证券	2	—	—	—	—	—
天风 证券	1	11,056,591.59	19.09%	8,085.44	19.09%	—
西部 证券	1	155,119.50	0.27%	113.44	0.27%	—
西南 证券	1	—	—	—	—	—
信达 证券	1	—	—	—	—	—
兴业 证券	2	—	—	—	—	—
银河 证券	2	—	—	—	—	—

招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	6,111,794.37	10.55%	4,469.68	10.55%	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中信证券华南	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	7,976,808.80	1.18%	4,068,600,000.00	17.99%	-	-	-	-
渤海证券	143,370,700.00	21.20%	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	82,401,516.49	12.18%	2,818,300,000.00	12.46%	-	-	-	-

东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	70,878,801.13	10.48%	1,215,800,000.00	5.37%	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证 券	96,587,095.53	14.28%	998,600,000.00	4.41%	-	-	-	-
高华证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证 券	24,191,726.80	3.58%	2,161,600,000.00	9.56%	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	31,427,790.00	4.65%	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	45,426,337.50	6.72%	2,474,000,000.00	10.94%	-	-	-	-
宏源证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证 券	44,514,031.47	6.58%	496,450,000.00	2.19%	-	-	-	-
华泰联 合证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	18,523,973.10	2.74%	2,708,500,000.00	11.97%	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	47,331,156.60	7.00%	3,236,800,000.00	14.31%	-	-	-	-
西部证 券	40,110,529.32	5.93%	557,400,000.00	2.46%	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公 司	23,691,635.10	3.50%	1,885,600,000.00	8.34%	-	-	-	-

中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券华南	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于系统升级维护的通知	中国证监会指定媒介	2020-01-03
2	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-01-07
3	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在泰信财富基金销售有限公司暂停办理基金销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-01-11
4	天弘基金管理有限公司关于深圳分公司经营场所变更的公告	中国证监会指定媒介	2020-01-18
5	天弘安康颐养混合型证券投资基金 2019年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2020-01-20
6	天弘基金管理有限公司及全资子公司投资旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会指定媒介	2020-02-04
7	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金在天津银行股份有限公司开通转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-02
8	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京植信基金销售有限公司开通定投、转换业务以及参加申购费率	中国证监会指定媒介	2020-03-11

	优惠活动的公告		
9	天弘基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-25
10	天弘基金管理有限公司关于调整网上直销交易系统通联支付渠道费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-02
11	天弘基金管理有限公司关于提醒客户及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-04
12	天弘基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-04
13	天弘安康颐养混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2020-04-14
14	天弘安康颐养混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2020-04-14
15	天弘安康颐养混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2020-04-14
16	天弘安康颐养混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2020-04-14
17	天弘基金管理有限公司关于天弘安康颐养混合型证券投资基金增设份额并相应修改相关法律文件的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-14
18	天弘基金管理有限公司关于天弘安康颐养混合型证券投资基金之C类基金份额开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-14

19	天弘安康颐养混合型证券投资基金2020年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2020-04-22
20	天弘基金管理有限公司关于增加广东顺德农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-22
21	天弘安康颐养混合型证券投资基金2019年年度报告	中国证监会指定媒介	2020-04-24
22	天弘基金管理有限公司关于增加交通银行股份有限公司为天弘安康颐养混合型证券投资基金C类基金份额销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-24
23	天弘基金管理有限公司关于增加万联证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-05-22
24	天弘基金管理有限公司关于增加中国银河证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-06-03
25	天弘基金管理有限公司关于增聘天弘安康颐养混合型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定媒介	2020-06-12
26	天弘安康颐养混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2020-06-17

27	天弘安康颐养混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2020-06-17
28	天弘基金管理有限公司关于增加大连网金基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-06-24
29	天弘基金管理有限公司关于调整天弘安康颐养混合型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定媒介	2020-06-24

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200101-20200303, 20200323-20200330	90,771,558.25	-	-	90,771,558.25	16.84%
产品特有风险							
基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括： （1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险； （2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险； （3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风							

险；

（4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；

（5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

11.2 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，与基金托管人协商一致，决定自2020年4月14日起增加天弘安康颐养混合型证券投资基金C类基金份额并相应修改基金合同等法律文件。具体信息请参见基金管理人在指定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于天弘安康颐养混合型证券投资基金增设份额并相应修改相关法律文件的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘安康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

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二〇年八月三十一日

