天弘安康颐利混合型证券投资基金

2026年第3季度报告

2026年09月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2026年10月27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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月23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2026年07月01日起至2026年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘安康颐利混合
基金主代码	013267
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年04月15日
报告期末基金份额总额	11,744,779.27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。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	中证全债指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%。
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。本基金若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。			
基金管理人	天弘基金管理有限公司			
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司			
下属分级基金的基金简称	天弘安康颐利混合A	天弘安康颐利混合C	天弘安康颐利混合E	天弘安康颐利混合F
下属分级基金的交易代码	013267	013268	022296	022555
报告期末下属分级基金的份额总额	6,146,013.94份	712,782.83份	4,884,411.99份	1,570.51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(2026年07月01日 - 2026年09月30日)			
	天弘安康颐利混合A	天弘安康颐利混合C	天弘安康颐利混合E	天弘安康颐利混合F
1.本期已实现收益	53,423.82	5,987.64	44,633.68	11.13
2.本期利润	80,875.16	8,884.85	68,074.49	17.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.0128	0.0123	0.0129	0.0109
4.期末基金资产净值	6,528,090.63	753,693.73	5,185,743.11	1,656.71
5.期末基金份额净值	1.0622	1.0574	1.0617	1.0549

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

天弘安康颐利混合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	1.17%	0.09%	-0.30%	0.13%	1.47%	-0.04%
过去六个月	-0.26%	0.09%	2.31%	0.15%	-2.57%	-0.06%
过去一年	0.32%	0.09%	2.85%	0.15%	-2.53%	-0.06%
过去三年	7.29%	0.10%	16.76%	0.16%	-9.47%	-0.06%
自基金合同生效日起至今	6.22%	0.15%	20.95%	0.16%	-14.73%	-0.01%

天弘安康颐利混合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	1.17%	0.08%	-0.30%	0.13%	1.47%	-0.05%
过去六个月	-0.27%	0.09%	2.31%	0.15%	-2.58%	-0.06%
过去一年	0.31%	0.09%	2.85%	0.15%	-2.54%	-0.06%
过去三年	7.12%	0.10%	16.76%	0.16%	-9.64%	-0.06%
自基金合同生效日起至今	5.74%	0.15%	20.95%	0.16%	-15.21%	-0.01%

天弘安康颐利混合E净值表现

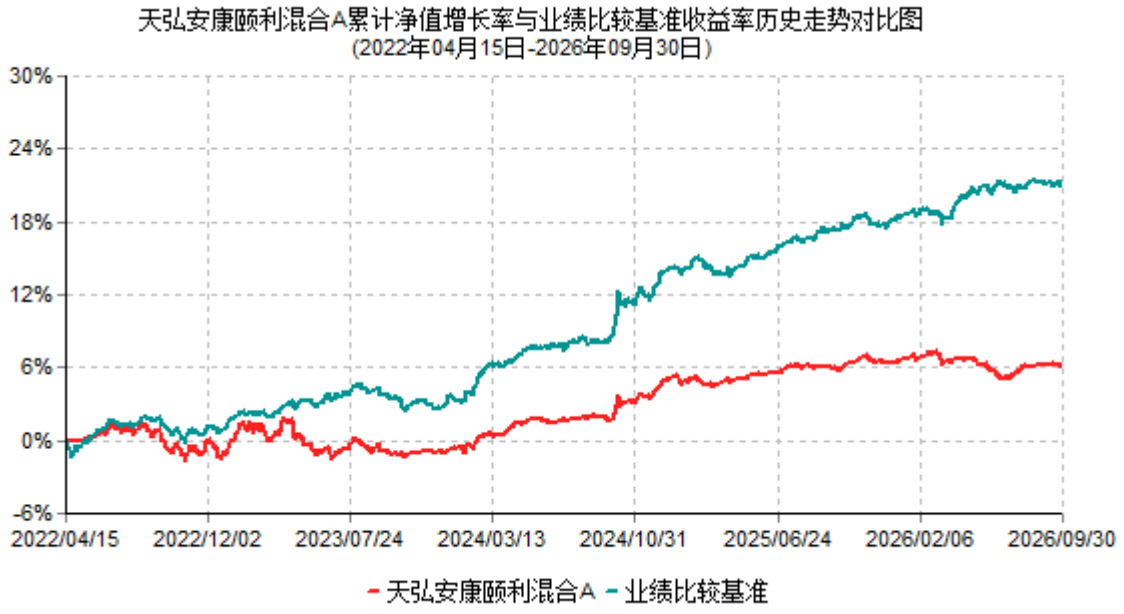
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.17%	0.08%	-0.30%	0.13%	1.47%	-0.05%
过去六个月	-0.26%	0.09%	2.31%	0.15%	-2.57%	-0.06%
过去一年	0.32%	0.09%	2.85%	0.15%	-2.53%	-0.06%
自基金份额	2.96%	0.09%	8.79%	0.15%	-5.83%	-0.06%

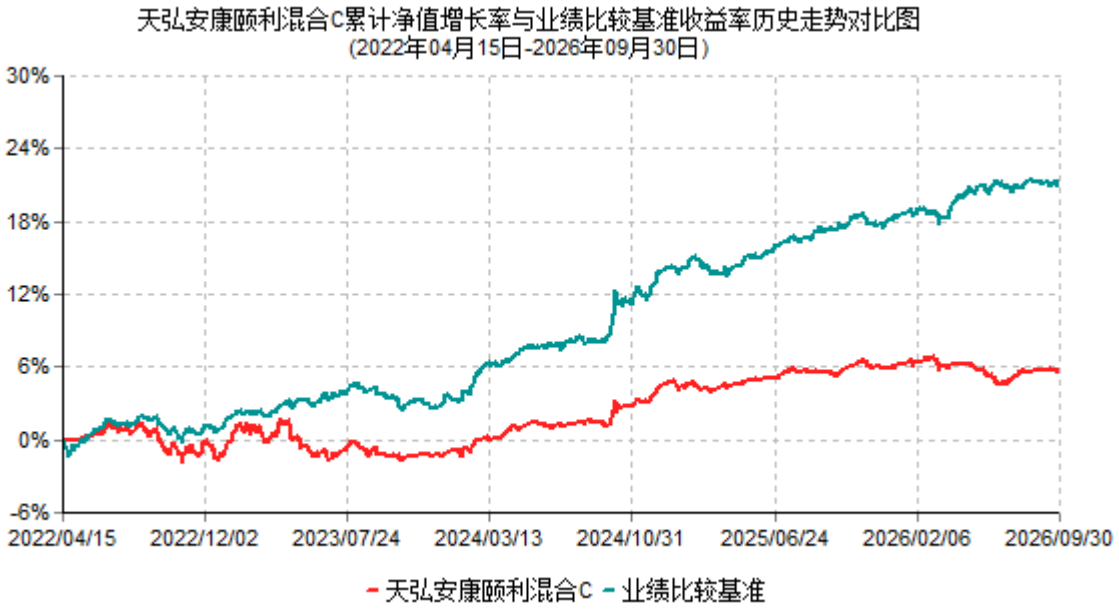
首次确认日起至今						

天弘安康颐利混合F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	1.05%	0.09%	-0.30%	0.13%	1.35%	-0.04%
过去六个月	-0.46%	0.09%	2.31%	0.15%	-2.77%	-0.06%
过去一年	-0.06%	0.09%	2.85%	0.15%	-2.91%	-0.06%
自基金份额首次确认日起至今	1.86%	0.09%	8.05%	0.15%	-6.19%	-0.06%

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




天弘安康颐利混合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
(2022年04月15日-2026年09月30日)
30%
24%
18%
12%
6%
0%
-6%
2022/04/15
2022/12/02
2023/07/24
2024/03/13
2024/10/31
2025/06/24
2026/02/06
2026/09/30
天弘安康颐利混合C
业绩比较基准


天弘安康颐利混合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
(2024年10月31日-2026年09月30日)
10.50%
9.00%
7.50%
6.00%
4.50%
3.00%
1.50%
0.00%
2024/10/31
2025/02/11
2025/05/21
2025/08/25
2025/12/03
2026/03/18
2026/06/26
2026/09/30
天弘安康颐利混合E
业绩比较基准



注：1、本基金合同于2022年04月15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2024年10月30日起增设天弘安康颐利混合E基金份额。天弘安康颐利混合E基金份额的首次确认日为2024年10月31日。本基金自2024年11月07日起增设天弘安康颐利混合F基金份额。天弘安康颐利混合F基金份额的首次确认日为2024年11月18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		
宛茹雪	本基金基金经理	2024年11月16日	-	9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。
贺剑	本基金基金经理	2022年04月15日	-	19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。

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《证券基金经营机构董事、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遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规有关规定及基金合同相关约定进行运作，不存在违法违规或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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、相关法律法规规定和基金合同约定，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 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0次，未发生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

三季度海外地缘冲突推高油价，美债利率持续走高，国内经济分化延续，生产出口韧性强，但尚未带动广泛内需的回升。

报告期内，股票综合指数承压向下，风格上价值和红利明显跑赢、科技成长板块深度回撤；债券方面，流动性宽松叠加风险偏好回落，长债利率一度创下年内新低、收益

率曲线平坦化下行。运作期内，权益部分维持稳定的仓位继续投资于自由现金流水平较高且稳定性较好的上市公司股票，债券部分则提升久期增厚组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2026年09月30日，天弘安康颐利混合A基金份额净值为1.0622元，天弘安康颐利混合C基金份额净值为1.0574元，天弘安康颐利混合E基金份额净值为1.0617元，天弘安康颐利混合F基金份额净值为1.0549元。报告期内份额净值增长率天弘安康颐利混合A为1.17%，同期业绩比较基准增长率为-0.30%；天弘安康颐利混合C为1.17%，同期业绩比较基准增长率为-0.30%；天弘安康颐利混合E为1.17%，同期业绩比较基准增长率为-0.30%；天弘安康颐利混合F为1.05%，同期业绩比较基准增长率为-0.30%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内存在连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，基金管理人已向中国证监会报告并采取适当措施。本报告期内，自2026年07月01日起至2026年09月30日，由本基金管理人承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用，不再从基金资产中计提。

§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	1,009,126.51	7.73
	其中：股票	1,009,126.51	7.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,303,103.78	78.96
	其中：债券	10,303,103.78	78.96
	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	799,937.06	6.13
	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	384,507.19	2.95
8	其他资产	552,096.63	4.23

9	合计	13,048,771.17	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	103,602.00	0.83
C	制造业	651,856.51	5.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,386.00	0.04
E	建筑业	19,936.00	0.16
F	批发和零售业	13,074.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	39,615.00	0.32
H	住宿和餐饮业	5,505.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	161,884.00	1.30
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	6,156.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	2,112.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	1,009,126.51	8.09

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	601728	中国电信	16,500	103,620.00	0.83

2	600938	中国海油	3,100	103,602.00	0.83
3	600104	上汽集团	8,600	93,568.00	0.75
4	601600	中国铝业	7,700	68,761.00	0.55
5	000651	格力电器	1,700	65,076.00	0.52
6	600050	中国联通	13,400	56,682.00	0.45
7	601877	XD正泰电	2,100	52,395.00	0.42
8	000338	潍柴动力	2,000	50,200.00	0.40
9	601633	长城汽车	3,600	49,428.00	0.40
10	600019	宝钢股份	4,600	27,278.00	0.22

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	10,303,103.78	82.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,303,103.78	82.63

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	019672	22国债07	50,000	5,096,913.70	40.88
2	019839	26国债10	40,000	4,041,000.55	32.41
3	019742	24特国01	6,000	660,861.04	5.30
4	019827	26国债01	5,000	504,328.49	4.04

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同约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	959.10
2	应收证券清算款	551,137.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	552,096.63

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

	天弘安康颐利混合A	天弘安康颐利混合C	天弘安康颐利混合E	天弘安康颐利混合F
报告期期初基金份额总额	6,705,231.03	744,325.69	5,596,363.22	1,752.28
报告期期间基金总申购份额	5,967.59	29,147.60	1,885.32	104.26
减：报告期期间基金总赎回份额	565,184.68	60,690.46	713,836.55	286.03
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	6,146,013.94	712,782.83	4,884,411.99	1,570.51

§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

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

在本报告期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》等相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于持续运作天弘安康颐利混合型证券投资基金的议案》，根据计票结果未达到法定的基金份额持有人大会召开条件。

基金管理人已就本次会议情况报中国证券监督管理委员会备案。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天弘安康颐利混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金注册的文件

2、基金合同

3、托管协议

4、招募说明书

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

6、基金管理人业务资格批件、营业执照

7、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住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

二〇二六年十月二十七日