

安信永丰定期开放债券型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告

2018 年 09 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 10 月 25 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 24 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 2018 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信永丰定开债券
基金主代码	003273
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2016 年 10 月 10 日
报告期末基金份额总额	101,667,668.16 份
投资目标	在严格控制信用风险的前提下，通过稳健的投资策略，力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	封闭期内，在组合久期配置上，本基金将遵守投资组合久期与封闭期适当匹配的原则，确定投资组合的久期配置。在品种配置上，合理配置并调整国债、央票、金融债、企业债、公司债等不同债券类属券种在投资组合中的构成比例。在信用投资上，采取内外部评级结合的方法，建立信用债券的研究库和投资库，并进行动态调整和维护，适时调整投资组合。此外，本基金还将投资于可转换债券、

	资产支持证券和国债期货等。 开放期内，本基金将主要投资于高流动性的投资品种以保持较高的组合流动性，减小基金净值的波动。	
业绩比较基准	中债总指数（全价）收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益水平和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信永丰定开债券 A	安信永丰定开债券 C
下属分级基金的交易代码	003273	003274
报告期末下属分级基金的份额总额	76,899,230.81 份	24,768,437.35 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(2018年07月01日 - 2018年09月30日)	
	安信永丰定开债券 A	安信永丰定开债券 C
1. 本期已实现收益	-395,971.35	-134,714.31
2. 本期利润	1,011,543.22	288,521.32
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0121	0.0112
4. 期末基金资产净值	76,683,715.62	24,591,440.50
5. 期末基金份额净值	0.9972	0.9929

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，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（不含公允价值变动损益）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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

安信永丰定开债券 A

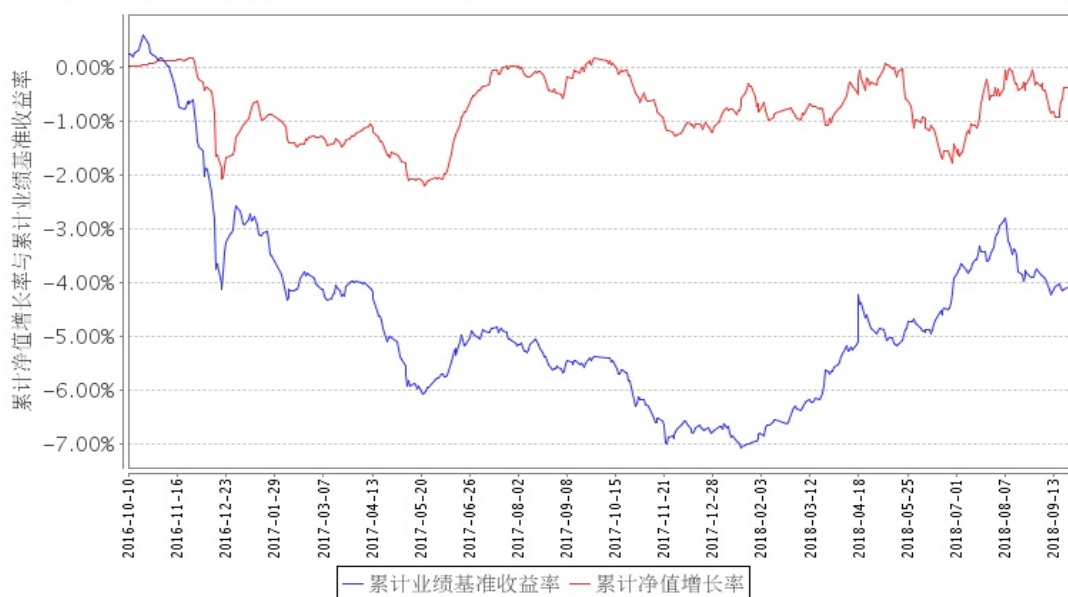
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.17%	0.14%	0.17%	0.10%	1.00%	0.04%

安信永丰定开债券 C

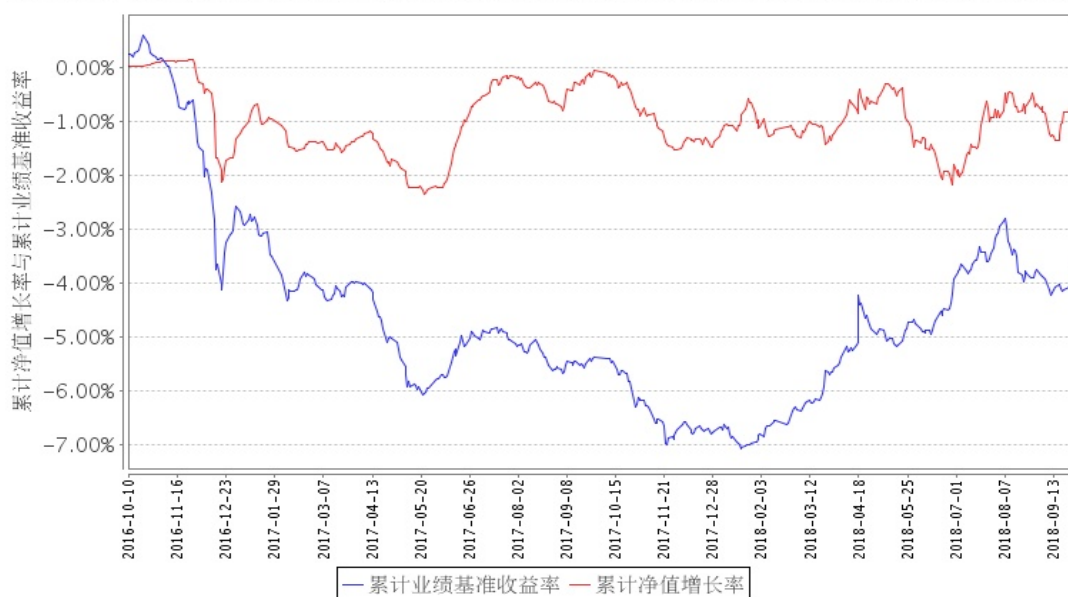
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.12%	0.14%	0.17%	0.10%	0.95%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

安信永丰定开债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信永丰定开债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2016 年 10 月 10 日。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 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		
睦芳韞	本基金的基金	2017 年 2 月 17 日	-	13 年	睦芳韞女士，经济学、理学双学士。曾任中国光大银行股份有限公司深

	经理				圳分行任资金部交易员、中国银行股份有限公司总行任金融市场总部投资经理。2015 年 9 月加入安信基金管理有限责任公司任固定收益部投资经理，现任固定收益部基金经理。现任安信永丰定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
--	----	--	--	--	---

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。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不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，受到前期涨幅较大等因素影响，债市整体震荡调整。其中短端利率受到资金面宽松等因素影响，保持稳定，但中长端利率持续上行，10 年国开收益率上行约 20bps。利率债调整幅度大于信用债。低等级信用债违约频出，信用利差依然较大。

报告期内，我们继续坚持了中等久期和中性杠杆的策略。本基金收益平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类基金份额净值为 0.9972 元，本报告期基金份额净值增长率为

1.17%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 0.9929 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.12%；同期业绩比较基准收益率为 0.17%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	114,414,270.17	83.13
	其中：债券	114,414,270.17	83.13
	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	5,515,241.98	4.01
8	其他资产	17,711,647.47	12.87
9	合计	137,641,159.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,179,280.00	11.04
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	83,093,584.30	82.05
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	20,141,405.87	19.89
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	114,414,270.17	112.97

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	1680435	16 泉州城投小微债	100,000	9,984,000.00	9.86
2	136115	15 广证 G2	100,000	9,977,000.00	9.85
3	136845	16 环球 03	100,000	9,925,000.00	9.80
4	112479	16 珠海债	100,000	9,924,000.00	9.80
5	112380	16 东林 01	100,000	9,890,000.00	9.77

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

基金投资的前十名证券的发行主体除 16 环球 03（证券代码：136845），本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中国环球租赁有限公司于 2018 年 7 月 17 日收到国家外汇管理局北京外汇管理部行政处罚书（京汇罚〔2018〕23 号），因未按照规定进行国际收支统计申报，违反《外汇管理条例》第四十八条第（一）项，被予以警告，罚款 7 万元，并责令改正。

基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	6,816.44
2	应收证券清算款	15,392,996.12
3	应收股利	-
4	应收利息	2,311,834.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,711,647.47

5.10.4 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 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	123006	东财转债	4,613,905.80	4.56
2	113011	光大转债	4,334,400.00	4.28
3	110032	三一转债	3,807,900.00	3.76
4	110038	济川转债	1,989,170.00	1.96
5	110033	国贸转债	727,110.40	0.72
6	128029	太阳转债	441,360.00	0.44
7	128017	金禾转债	103,553.67	0.10

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：
份

项目	安信永丰定开债券 A	安信永丰定开债券 C
报告期期初基金份额总额	88,720,339.94	26,437,128.68
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	11,821,109.13	1,668,691.33
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	76,899,230.81	24,768,437.35

§ 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

本报告期末本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信永丰定期开放债券型证券投资基金募集的文件；

- 2、《安信永丰定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信永丰定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信永丰定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2018 年 10 月 25 日