

安信永丰定期开放债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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：2021 年 10 月 26 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 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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	11,875,093.06 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	<p>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。</p> <p>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。</p>	
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	6, 220, 597. 22 份	5, 654, 495. 84 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 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	537, 301. 99	287, 929. 65
2. 本期利润	399, 398. 34	188, 149. 64
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0306	0. 0310
4. 期末基金资产净值	7, 160, 271. 75	6, 442, 042. 11
5. 期末基金份额净值	1. 1511	1. 1393

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 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	2. 90%	0. 24%	1. 25%	0. 10%	1. 65%	0. 14%
过去六个月	4. 83%	0. 18%	1. 72%	0. 08%	3. 11%	0. 10%
过去一年	6. 78%	0. 14%	2. 54%	0. 08%	4. 24%	0. 06%
过去三年	15. 43%	0. 10%	5. 43%	0. 11%	10. 00%	-0. 01%
自基金合同生效起至今	15. 11%	0. 10%	1. 46%	0. 12%	13. 65%	-0. 02%

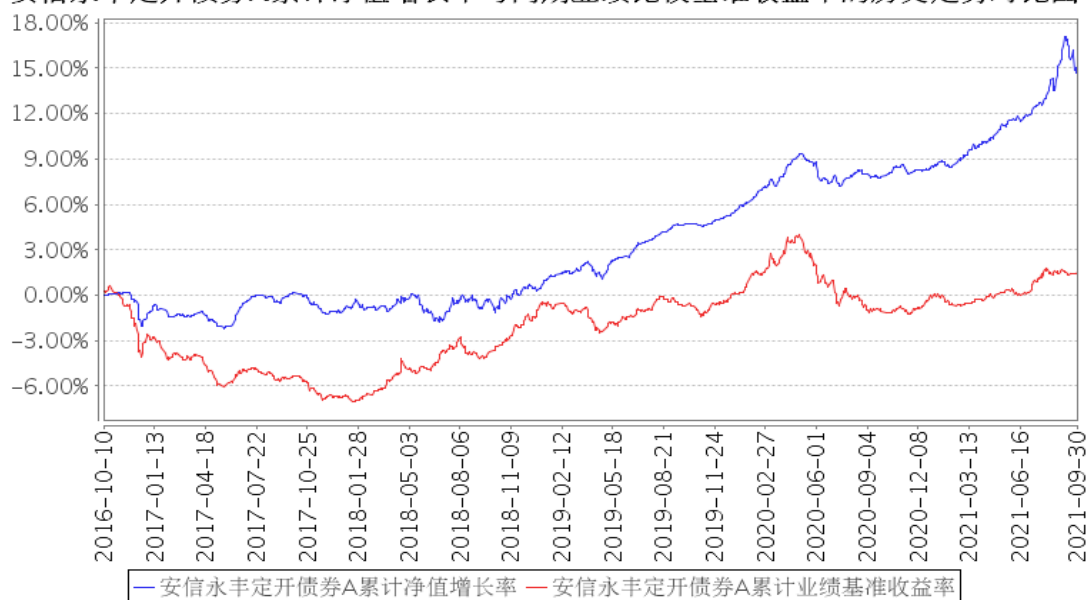
安信永丰定开债券 C

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

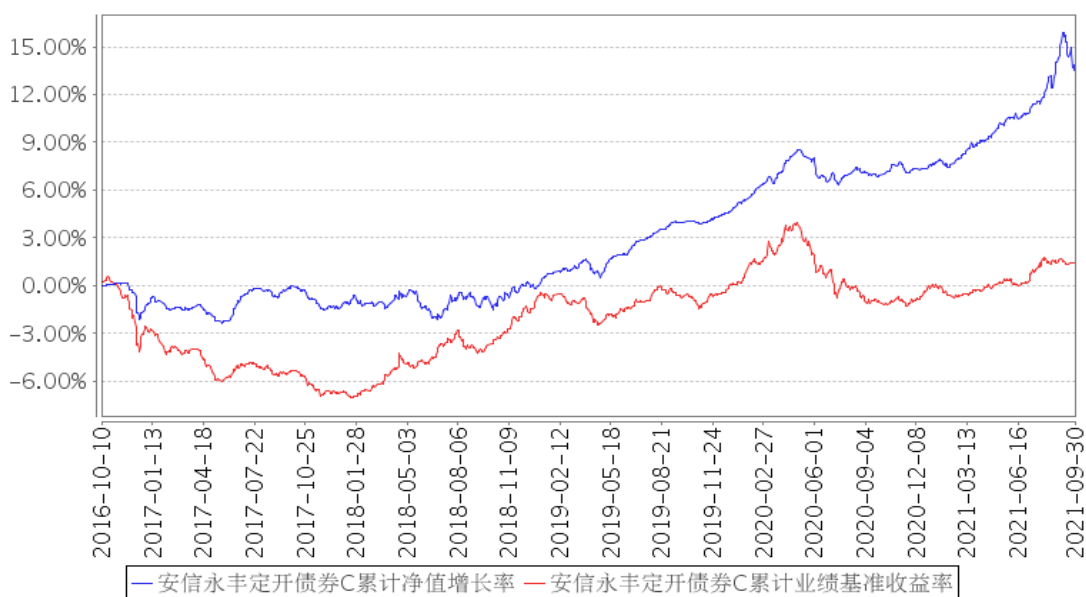
				④		
过去三个月	2.84%	0.24%	1.25%	0.10%	1.59%	0.14%
过去六个月	4.72%	0.18%	1.72%	0.08%	3.00%	0.10%
过去一年	6.57%	0.14%	2.54%	0.08%	4.03%	0.06%
过去三年	14.74%	0.10%	5.43%	0.11%	9.31%	-0.01%
自基金合同生效起至今	13.93%	0.10%	1.46%	0.12%	12.47%	-0.02%

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		
张睿	本基金的基金经理，固定收益部总经理	2021年8月10日	-	14年	张睿先生，经济学硕士，历任中国农业银行股份有限公司金融市场部产品经理、交易员，中信银行股份有限公司资金资本市场部投资经理，安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理，暖流资产管理股份有限公司固定收益部总经理，东兴证券股份有限公司资产管理业务总部副总经理兼固收总监。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部总经理。现任安信永丰定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
宛晴	本基金的基金经理	2021年7月14日	-	8年	宛晴女士，工商管理硕士，历任东兴证券股份有限公司资产管理业务总部交易员、交易主管、投资经理助理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信现金增利货币市场基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

潘巍	本基金的基金经理	2018年12月4日	2021年7月14日	12年	潘巍先生，理学硕士。历任中信证券股份有限公司资产管理部股票研究员、信用研究员，中华联合保险控股股份有限公司债券投资经理，华夏基金管理有限公司专户投资经理，安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信睿享纯债债券型证券投资基金、安信优享纯债债券型证券投资基金、安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、的基金经理；现任安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集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运作分析

2021 年三季度国内经济上行动能边际减弱，内外需有所分化，内需受国内局地汛情疫情、“能耗双控”及楼市调控持续加码等因素的影响呈现走弱态势，外需则因德塔毒株蔓延、海外产需缺口扩大得以支撑。受政策驱动，投资方面基建投资偏弱、房地产和制造业投资持续回落。消费方面，疫情影响下中低收入人群的消费动能恢复不足。通胀方面，受上游原材料持续涨价影响，PPI 和 CPI 的剪刀差不断拉大，中下游企业利润受到挤压。经济和金融数据的整体走弱，伴随全球能源转型中的供需矛盾加剧，加大了市场对类滞胀的担忧。伴随央行降准，8、9 月政府债券发行有所提速，叠加全球流动性收紧预期的扰动，三季度债券市场呈现收益率“V”型走势。权益市场延续结构性行情，新能源、军工、周期、消费等热点板块轮流上涨，个股方面百花齐放，但在板块和个股间的轮动加快。转债市场也呈现结构性行情，热点板块和低估值的转债取得了显著的正收益。

本基金操作方面，8 月初调高了可转债的投资比例、适当调低了信用债的投资比例。

4.5 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 1.1511 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.90%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.1393 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.84%；同期业绩比较基准收益率为 1.25%。

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，本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2021 年 7 月 1 日至 2021 年 9 月 30 日。

自 2021 年 4 月 26 日至本报告期末，本基金出现了连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已根据法律法规及基金合同要求拟定相关解决方案上报中国证券监督管理委员会。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,242,148.70	81.74
	其中：债券	11,242,148.70	81.74
	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	1,484,000.00	10.79
	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	893,314.19	6.50
8	其他资产	133,658.00	0.97
9	合计	13,753,120.89	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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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。

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

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	1,667,248.80	12.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,058,610.10	15.13
	其中：政策性金融债	2,058,610.10	15.13
4	企业债券	3,369,820.40	24.77
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,146,469.40	30.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,242,148.70	82.65

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	019649	21 国债 01	12,000	1,200,960.00	8.83
2	136234	16 保利 04	9,270	951,472.80	6.99
3	127458	16 济市中	18,930	734,105.40	5.40
4	018010	国开 1902	4,990	502,942.10	3.70
5	019547	16 国债 19	4,720	466,288.80	3.43

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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现所资产的长期稳定增值。

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内基金投资的前十名证券除国开 2005（证券代码：018014 SH）、国开 2003（证券代码：018012 SH）、国开 1902（证券代码：018010 SH）外其他证券未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2020 年 10 月 26 日，国家开发银行因涉嫌违反法律法规被国家外汇管理局北京外汇管理部罚款 60 万元【京汇罚（2020）33 号、京汇罚（2020）32 号】。

2021 年 1 月 8 日，国家开发银行因提供虚假材料或隐瞒真实情况、弄虚作假，违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款 4,880 万元【银保监罚决字（2020）67 号】。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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（元）
1	存出保证金	3,458.74
2	应收证券清算款	12,503.60
3	应收股利	-
4	应收利息	117,695.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	133,658.00

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110075	南航转债	87,840.00	0.65
2	128132	交建转债	81,528.00	0.60
3	128063	未来转债	80,500.00	0.59
4	127005	长证转债	75,312.00	0.55
5	123031	晶瑞转债	69,289.50	0.51
6	110064	建工转债	68,581.50	0.50
7	128014	永东转债	66,804.00	0.49

8	113594	淳中转债	65,556.00	0.48
9	113026	核能转债	65,485.00	0.48
10	113530	大丰转债	65,454.00	0.48
11	132018	G 三峡 EB1	65,420.00	0.48
12	128037	岩土转债	65,106.00	0.48
13	113021	中信转债	64,104.00	0.47
14	113519	长久转债	63,336.00	0.47
15	110070	凌钢转债	63,060.00	0.46
16	123076	强力转债	62,472.00	0.46
17	123048	应急转债	62,010.00	0.46
18	110043	无锡转债	59,100.00	0.43
19	110038	济川转债	58,723.50	0.43
20	113591	胜达转债	58,140.00	0.43
21	127014	北方转债	57,525.00	0.42
22	113011	光大转债	56,935.00	0.42
23	128073	哈尔转债	56,345.00	0.41
24	123064	万孚转债	55,460.00	0.41
25	113574	华体转债	54,090.00	0.40
26	132022	20 广版 EB	53,916.90	0.40
27	127028	英特转债	53,785.00	0.40
28	113532	海环转债	52,420.00	0.39
29	123056	雪榕转债	52,330.00	0.38
30	113033	利群转债	51,885.00	0.38
31	128125	华阳转债	51,820.00	0.38
32	113541	荣晟转债	51,380.00	0.38
33	113569	科达转债	50,685.00	0.37
34	132020	19 蓝星 EB	49,118.00	0.36
35	128145	日丰转债	48,988.00	0.36
36	128133	奇正转债	48,844.00	0.36
37	128114	正邦转债	48,402.00	0.36
38	113589	天创转债	48,380.00	0.36
39	113009	广汽转债	48,040.00	0.35
40	110047	山鹰转债	47,276.00	0.35
41	128048	张行转债	47,112.00	0.35
42	110053	苏银转债	46,704.00	0.34
43	128135	洽洽转债	46,664.00	0.34
44	113024	核建转债	46,216.00	0.34
45	123062	三超转债	45,956.00	0.34
46	113046	金田转债	44,036.00	0.32
47	128026	众兴转债	43,460.00	0.32
48	113524	奇精转债	43,440.00	0.32
49	128034	江银转债	43,096.00	0.32

50	113535	大业转债	42,568.00	0.31
51	113603	东缆转债	42,441.00	0.31
52	110077	洪城转债	39,009.00	0.29
53	123091	长海转债	38,526.00	0.28
54	110071	湖盐转债	38,328.00	0.28
55	113030	东风转债	37,617.00	0.28
56	127022	恒逸转债	37,035.00	0.27
57	128091	新天转债	36,672.00	0.27
58	123057	美联转债	36,462.00	0.27
59	132014	18 中化 EB	36,452.50	0.27
60	127020	中金转债	35,928.00	0.26
61	123104	卫宁转债	35,832.00	0.26
62	110063	鹰 19 转债	35,814.00	0.26
63	127018	本钢转债	35,718.00	0.26
64	113602	景 20 转债	35,367.00	0.26
65	127015	希望转债	34,254.00	0.25
66	128108	蓝帆转债	34,167.00	0.25
67	128107	交科转债	33,990.00	0.25
68	113570	百达转债	33,930.00	0.25
69	123039	开润转债	33,069.00	0.24
70	127026	超声转债	32,718.00	0.24
71	128123	国光转债	31,875.00	0.23
72	128117	道恩转债	31,746.00	0.23
73	113042	上银转债	31,149.00	0.23
74	123086	海兰转债	31,048.00	0.23
75	128075	远东转债	30,380.00	0.22
76	113017	吉视转债	30,138.00	0.22
77	110055	伊力转债	27,649.50	0.20
78	113505	杭电转债	24,008.00	0.18
79	127019	国城转债	20,084.00	0.15
80	113568	新春转债	10,340.00	0.08

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	23,512,197.03	6,790,359.94
报告期期间基金总申购份额	209,338.67	12,589.20
减:报告期期间基金总赎回份额	17,500,938.48	1,148,453.30
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	6,220,597.22	5,654,495.84

§ 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

本报告期内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

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	20210802-20210930	4,635,638.79	-	-	4,635,638.79	39.04
	2	20210701-20210805	9,554,706.16	-	9,554,706.16	-	-
个人	1	20210701-20210730	7,172,256.73	-	7,172,256.73	-	-

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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、中国证监会准予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

2021 年 10 月 26 日