

天弘安盈一年持有期债券型发起式证券投资基金

2021年第3季度报告

2021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:中国银河证券股份有限公司

报告送出日期:2021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。

基金托管人中国银河证券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07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	天弘安盈一年持有
基金主代码	012049
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年05月12日
报告期末基金份额总额	2,023,653,276.59份
投资目标	在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	主要投资策略包括：资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略。
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率×85%+沪深300指数收益率×12%+中证港股通综合指数收益率×3%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。本基金将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	中国银河证券股份有限公司

下属分级基金的基金简称	天弘安盈一年持有A	天弘安盈一年持有C
下属分级基金的交易代码	012049	012050
报告期末下属分级基金的份额总额	26,620,590.09份	1,997,032,686.50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07月01日 - 2021年09月30日)	
	天弘安盈一年持有A	天弘安盈一年持有C
1. 本期已实现收益	357,848.23	26,810,802.63
2. 本期利润	135,627.64	13,879,696.13
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0108	0.0150
4. 期末基金资产净值	27,567,589.01	2,065,293,278.15
5. 期末基金份额净值	1.0356	1.0342

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。

3.2 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

天弘安盈一年持有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	2.53%	0.27%	0.18%	0.19%	2.35%	0.08%
自基金合同生效日起至今	3.56%	0.23%	1.24%	0.17%	2.32%	0.06%

天弘安盈一年持有C净值表现

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	2.45%	0.26%	0.18%	0.19%	2.27%	0.07%
自基金合 同生效日 起至今	3.42%	0.23%	1.24%	0.17%	2.18%	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

天弘安盈一年持有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

(2021年05月12日-2021年09月30日)



天弘安盈一年持有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



注：1、本基金合同于2021年05月12日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2021年05月12日至2021年11月11日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§ 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		
姜晓丽	固定收益机构投资部总经理、固定收益部总经理、宏观研究部总经理、本基金基金经理	2021年05月	-	12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。
贺剑	本基金基金经理	2021	-	14	男，金融学硕士。历任华

		年05 月		年	夏基金管理有限公司风险分析师、研究员等，2020年5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、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。

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交易中，未产生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，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

安盈今年5月初成立，截至3季度，组合在纯债、转债、权益方面均积极操作，整体来看贡献了稳健收益。在市场没有明显趋势的情况下，根据组合特点，长期拟保持权益仓位稳定，转债仓位根据市场状态略作调整，纯债部分保持稳定贡献票息收益；行业配置方面，组合综合考虑行业景气度和估值，均衡配置。三季度主要投资策略是考虑到组合刚成立，持仓偏低估值，对今年的震荡走势采取逆向投资策略。纯债部分仓位中性配

置，久期不超过1.5年，以获取票息和骑乘收益为主。考虑到转债市场估值，转债部分降低了仓位和中高价转债的比例。

四季度资金整体维持中性观点，主要原因是经济结构性矛盾仍较突出，外围冲击仍很难忽视，很难在资金面上收紧；在新能源整体推进的过程中，原有经济格局的结构性矛盾会不时凸显带来经济的边际影响，经济处于震荡区间。

四季度债市持震荡观点，预计收益可能在票息附近，纯债的机会来自于事件冲击后的收益上行或利差扩大；转债估值目前不算便宜，以争取正收益为操作准绳；股票市场没有系统性机会，转债也很难走出较大行情，考虑到目前转债只数较多，且转债相对正股，存在大量结构性的机会，通过控制整体转债持仓的仓位，自下而上精选个券，转债仍有望能获得明显超出纯债的收益。对于纯权益部分，作为组合风险暴露比较大的部分，我们根据投资者结构特点，权益和转债互为补充，在降低组合波动性的情况下以贡献绝对收益作为主要操作目标。

市场风险点主要关注部分赛道股的估值是否会压缩和美元与美国国债收益率的走势；超额收益可能来自消费科技股的投资及转债品种的个券机会。

21年市场波动较大，肩负投资者的信任，最后一个季度，组合将更看重基本面和估值的匹配度，力争为投资者获取稳健收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2021年09月30日，天弘安盈一年持有A基金份额净值为1.0356元，天弘安盈一年持有C基金份额净值为1.0342元。报告期内份额净值增长率天弘安盈一年持有A为2.53%，同期业绩比较基准增长率为0.18%；天弘安盈一年持有C为2.45%，同期业绩比较基准增长率为0.18%。

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	328,559,615.96	13.84
	其中：股票	328,559,615.96	13.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,955,984,411.95	82.37
	其中：债券	1,945,950,411.95	81.95
	资产支持证券	10,034,000.00	0.42

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	48,206,869.23	2.03
8	其他资产	41,754,706.37	1.76
9	合计	2,374,505,603.51	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	23,906,510.00	1.14
C	制造业	192,134,588.36	9.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,913,490.00	0.81
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,198,848.00	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,473,844.00	0.21
J	金融业	50,987,415.00	2.44
K	房地产业	17,562,642.00	0.84
L	租赁和商务服务业	3,120,000.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	9,262,278.60	0.44
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	328,559,615.96	15.70

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	600028	中国石化	4,258,500	18,992,910.00	0.91
2	600030	中信证券	687,600	17,382,528.00	0.83
3	600674	川投能源	1,177,000	16,913,490.00	0.81
4	000858	五粮液	75,619	16,590,052.41	0.79
5	002311	海大集团	229,200	15,448,080.00	0.74
6	600176	中国巨石	769,629	13,530,077.82	0.65
7	600036	招商银行	264,400	13,338,980.00	0.64
8	603707	健友股份	341,320	12,287,520.00	0.59
9	300630	普利制药	263,224	12,147,787.60	0.58
10	000333	美的集团	171,000	11,901,600.00	0.57

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	299,405,240.60	14.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	300,985,000.00	14.38
	其中：政策性金融债	300,985,000.00	14.38
4	企业债券	1,005,719,000.00	48.05
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	40,508,000.00	1.94
7	可转债（可交换债）	260,380,817.75	12.44
8	同业存单	38,900,000.00	1.86
9	其他	52,353.60	0.00
10	合计	1,945,950,411.95	92.98

注：其他项下包含地方政府债52,353.60元。

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	163937	20中核Y3	1,800,000	180,504,000.00	8.62
2	019641	20国债11	1,354,210	135,759,552.50	6.49
3	175404	20航控Y1	1,000,000	101,050,000.00	4.83
4	210316	21进出16	1,000,000	99,710,000.00	4.76
5	019628	20国债02	810,710	81,046,678.70	3.87

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	136214	荣耀13A	100,000	10,034,000.00	0.48

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2020年12月25日收到中国银行保险监督管理委员会出具罚款处罚的通报。

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	345,863.45
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	23,581,510.96
5	应收申购款	17,827,331.96
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	41,754,706.37

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	110064	建工转债	22,852,410.90	1.09
2	110052	贵广转债	19,804,857.60	0.95
3	128132	交建转债	16,294,899.45	0.78
4	123096	思创转债	12,908,630.40	0.62
5	110051	中天转债	12,674,946.60	0.61
6	110072	广汇转债	11,819,244.50	0.56
7	127019	国城转债	11,126,636.42	0.53
8	113620	傲农转债	10,965,572.80	0.52
9	127018	本钢转债	10,260,590.80	0.49
10	123004	铁汉转债	9,911,152.28	0.47
11	128083	新北转债	7,947,535.53	0.38
12	127029	中钢转债	7,590,340.80	0.36
13	127013	创维转债	7,542,666.20	0.36
14	128063	未来转债	7,265,700.00	0.35
15	113565	宏辉转债	7,112,646.20	0.34
16	128124	科华转债	6,586,889.19	0.31
17	128081	海亮转债	6,287,176.00	0.30
18	123056	雪榕转债	5,900,521.48	0.28
19	128037	岩土转债	5,604,107.46	0.27
20	128107	交科转债	4,967,072.00	0.24
21	123063	大禹转债	4,927,392.64	0.24
22	128015	久其转债	4,714,279.70	0.23
23	128018	时达转债	3,880,666.80	0.19
24	128023	亚太转债	3,829,393.80	0.18

25	127021	特发转2	3,711,563.93	0.18
26	113610	灵康转债	3,700,986.00	0.18
27	113530	大丰转债	3,670,878.50	0.18
28	127028	英特转债	3,659,423.83	0.17
29	113591	胜达转债	3,613,982.40	0.17
30	123077	汉得转债	3,507,932.24	0.17
31	113601	塞力转债	3,287,870.90	0.16
32	113535	大业转债	3,123,427.00	0.15
33	128141	旺能转债	2,990,934.10	0.14

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

	天弘安盈一年持有A	天弘安盈一年持有C
报告期期初基金份额总额	7,208,859.31	205,842,179.69
报告期期间基金总申购份额	19,411,730.78	1,791,190,506.81
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	26,620,590.09	1,997,032,686.50

注：总申购份额含转换转入份额。

§ 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

	天弘安盈一年持有A	天弘安盈一年持有C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,002,639.42	5,002,638.89
报告期期间买入/申购总份额	-	-

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	5,002,639.42	5,002,638.89
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	18.79	0.25

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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,005,278.31	0.49%	10,005,278.31	0.49%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,005,278.31	0.49%	10,005,278.31	0.49%	-

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘安盈一年持有期债券型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘安盈一年持有期债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、天弘安盈一年持有期债券型发起式证券投资基金托管协议
- 4、天弘安盈一年持有期债券型发起式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

10.2 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

10.3 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
二〇二一年十月二十七日