

东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资  
基金  
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴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 7 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	东方红安盈甄选一年持有混合
基金主代码	012683
基金运作方式	契约型开放式，但本基金对每份基金份额设置一年锁定持有期
基金合同生效日	2021 年 7 月 7 日
报告期末基金份额总额	693,589,503.18 份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中股票、债券和现金类大类资产的配置比例。本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势，并通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目

	标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。	
业绩比较基准	中债新综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×2%。	
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。	
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方红安盈甄选一年持有混合 A	东方红安盈甄选一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	012683	012684
报告期末下属分级基金的份额总额	429,081,654.03 份	264,507,849.15 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 7 日-2021 年 9 月 30 日）	
	东方红安盈甄选一年持有混合 A	东方红安盈甄选一年持有混合 C
1. 本期已实现收益	5,716,482.53	3,337,963.52
2. 本期利润	1,404,836.07	680,685.36
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0033	0.0026
4. 期末基金资产净值	430,486,490.10	265,188,534.51
5. 期末基金份额净值	1.0033	1.0026

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）本基金合同于 2021 年 7 月 7 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一季度。

#### 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

东方红安盈甄选一年持有混合 A

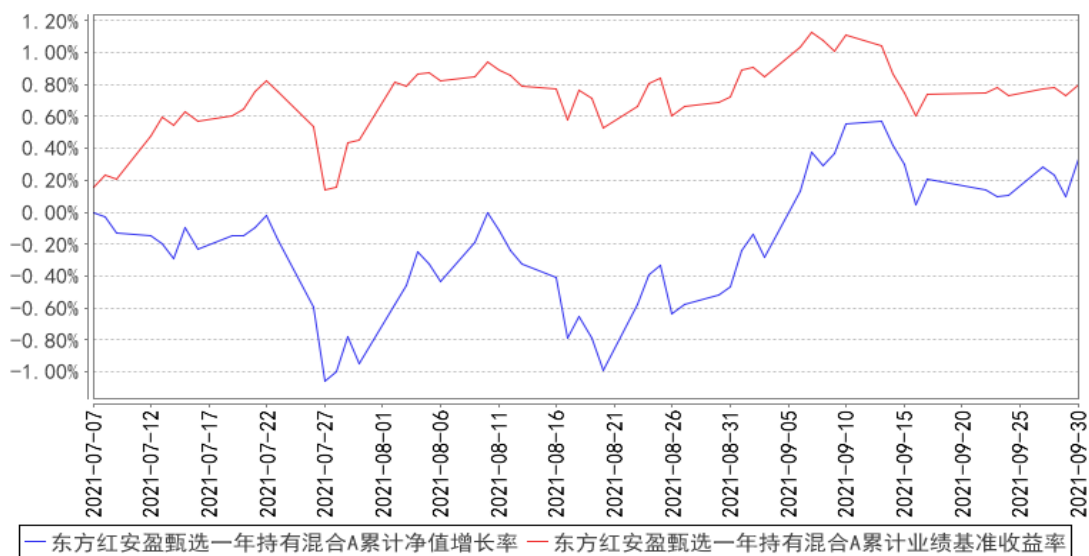
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.33%	0.19%	0.80%	0.13%	-0.47%	0.06%

东方红安盈甄选一年持有混合 C

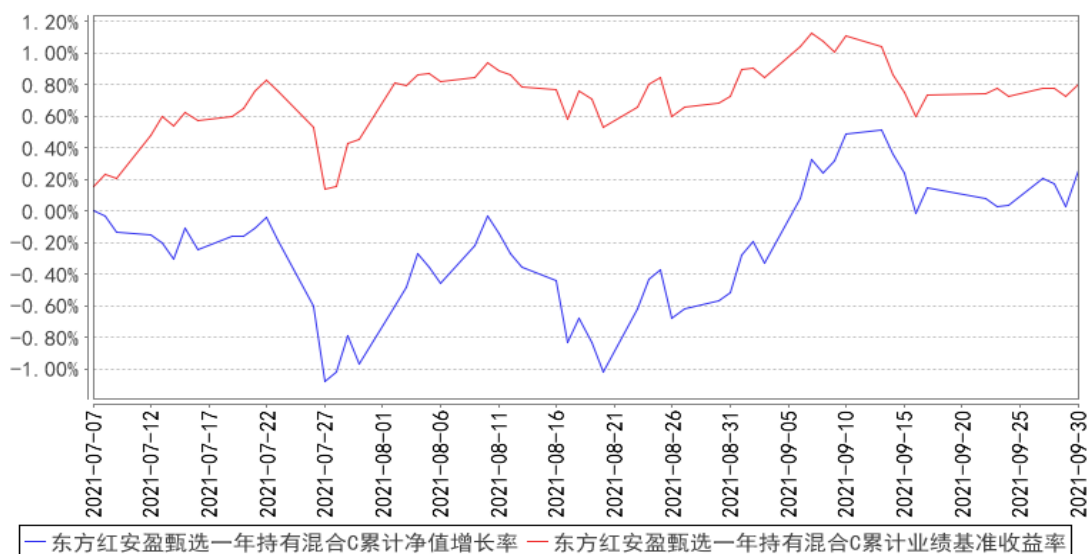
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.26%	0.19%	0.80%	0.13%	-0.54%	0.06%

### 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

东方红安盈甄选一年持有混合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



东方红安盈甄选一年持有混合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、本基金合同于 2021 年 7 月 7 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

2、本基金建仓期 6 个月，即从 2021 年 7 月 7 日起至 2022 年 1 月 6 日，至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## § 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		
胡伟	上海东方证券资产管理有限公司总经理助理、董事总经理兼任公募固定收益投资部总经理及固定收益研究部总经理、基金经理	2021 年 7 月 7 日	-	17 年	上海东方证券资产管理有限公司总经理助理、董事总经理，兼任公募固定收益投资部总经理及固定收益研究部总经理，基金经理，2020 年 05 月至今任东方红收益增强债券型证券投资基金基金经理、2020 年 05 月至今任东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金经理、2020 年 06 月至今任东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 06 月至今任东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 09 月至今任东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021 年 01 月至今任东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2021 年 07 月至今任 东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理。中南财经政法大学经济学学士。曾任珠海市商

					业银行资金营运部债券交易员,华富基金管理有限公司债券交易员,固定收益部基金经理、副总监、总监,总经理助理。具备证券投资基金从业资格。
高德勇	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2021 年 7 月 7 日	-	14 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理,2020 年 05 月至今任东方红货币市场基金基金经理、2021 年 01 月至今任东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2021 年 07 月至今任东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理。南京大学理学学士。曾任上海农商银行金融市场部货币市场科负责人、国泰君安证券股份有限公司资金同业部金融同业总监、华鑫证券销售交易部部门总经理。具备证券投资基金从业资格。

注: 1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日,“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期; 对此后非首任基金经理, 基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.1 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

注: 本基金基金经理本报告期末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, 上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人, 严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 为基金份额持有人谋求最大利益, 无损害基金持有人利益的行为, 本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合, 制定并严格遵守相应的制度和流程, 通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内, 本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金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 5%的情况。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

权益方面，三季度市场整体震荡，结构性分化较大，上证综指三季度下跌 0.64%，创业板指下跌 6.69%，中证 500 上涨 4.34%。三季度，受价格上涨以及产业政策等多方面催化，周期性行业的估值水平出现了较为明显的修复。本产品一方面仍配置了一些估值水平处于历史低位、股息回报率较高的大盘蓝筹公司；另一方面考虑到一些优质成长公司经过前期调整后，估值有所回落，本产品从中择优增加了配置比例。当前情况下，组合仍将维持这一配置思路。

转债方面，三季度转债表现较好，中证转债指数上涨 6.39%。目前转债估值水平相对较高，相比股票资产性价比一般，本产品转债配置比重有所下降。但长期来看转债仍然是较好的适合绝对收益的投资品种，本产品仍然会对转债市场保持密切跟踪研究和关注，坚持绝对收益的投资思路，结合公司本身的资质以及转债的估值定价水平，在合适机会下精选一些优质转债进行配置。

债券方面，三季度债券收益率先下后上，季初演绎了年内最大幅度的下行，但是季末随着时点因素、通胀预期重燃和美国收紧预期等因素共振，收益率开始上行，截止 9 月 30 日，十年国债收于 2.87。一方面，全球大宗商品上涨，引发了市场对通胀的担忧和对政策收紧的预期，美债收益率出现了明显的上行；另一方面，地产调控继续，出口数据转弱，国内经济复苏动能边际转弱，从基本面角度国内货币环境预计继续保持适度宽松。介于当前市场对于通胀预期的消化需要一定的时间和空间，同时，债券市场不同品种之间的分化和轮动加剧，本产品未来债券配置仍以中高等级信用债为主，合理控制组合久期，加大对信用挖掘和交易性机会的研究和发掘。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 1.0033 元，份额累计净值为 1.0033 元；C 类份额净值为 1.0026 元，份额累计净值为 1.0026 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 0.33%，同期业绩比较基准收益率为 0.80%；C 类份额净值增长率为 0.26%，同期业绩比较基准收益率为 0.80%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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	126,477,585.08	15.83
	其中：股票	126,477,585.08	15.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	657,276,266.40	82.29
	其中：债券	657,276,266.40	82.29
	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	7,035,632.46	0.88
8	其他资产	7,948,207.04	1.00
9	合计	798,737,690.98	100.00

注：1、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,834,398.00 元人民币，占期末基金资产净值比例 0.26%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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

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	3,412,596.00	0.49
C	制造业	96,562,360.43	13.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	1,556,343.45	0.22
J	金融业	17,826,347.00	2.56
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,236,000.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	1,344,640.00	0.19



N	水利、环境和公共设施管理业	24,640.20	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,680,260.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	124,643,187.08	17.92

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
00 能源	-	-
01 原材料	-	-
02 工业	-	-
03 可选消费	1,834,398.00	0.26
04 主要消费	-	-
05 医药卫生	-	-
06 金融地产	-	-
07 信息技术	-	-
08 电信业务	-	-
09 公用事业	-	-
合计	1,834,398.00	0.26

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 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

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	4,200	7,686,000.00	1.10
2	002415	海康威视	131,800	7,249,000.00	1.04
3	601012	隆基股份	84,200	6,944,816.00	1.00
4	600036	招商银行	135,200	6,820,840.00	0.98
5	002475	立讯精密	172,800	6,170,688.00	0.89
6	600887	伊利股份	160,300	6,043,310.00	0.87
7	300750	宁德时代	11,000	5,783,030.00	0.83
8	002459	晶澳科技	86,900	5,731,055.00	0.82
9	002245	蔚蓝锂芯	270,800	5,665,136.00	0.81
10	300122	智飞生物	29,900	4,753,801.00	0.68

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

#### 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	57,347,566.40	8.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,046,000.00	10.07
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	423,567,400.00	60.89
5	企业短期融资券	24,953,500.00	3.59
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,571,800.00	0.51
8	同业存单	77,790,000.00	11.18
9	其他	-	-
10	合计	657,276,266.40	94.48

#### 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	019654	21 国债 06	572,960	57,347,566.40	8.24
2	143275	17 沪国 01	500,000	50,895,000.00	7.32
3	112893	19 深投 03	500,000	50,425,000.00	7.25
4	112105128	21 建设银行 CD128	500,000	48,660,000.00	6.99
5	155487	19 海宁 01	300,000	30,324,000.00	4.36

#### 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

注：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

注：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

注：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

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行股指期货投资。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以获取相应股票组合的超额收益。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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

本基金持有的 21 建设银行 CD128（代码：112105128 IB）的发行主体中国建设银行股份有限公司因占压财政存款或资金、违反账户管理规定的行为于 2021 年 8 月 13 日被中国人民银行处以警告并处罚款 388 万元。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余证券的发行主体本期未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。

### 5.11.2 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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	61,439.83
2	应收证券清算款	398,090.42
3	应收股利	-
4	应收利息	7,488,676.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,948,207.04

#### 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	113013	国君转债	3,571,800.00	0.51

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

#### 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，投资组合报告中市值占净值比例的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

项目	东方红安盈甄选一年持有混合 A	东方红安盈甄选一年持有混合 C
基金合同生效日(2021年7月7日)基金份额总额	429,081,654.03	264,507,849.15
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	429,081,654.03	264,507,849.15

注：本基金（A类）合同生效日为2021年7月7日，本基金（C类）合同生效日为2021年7月7日。

## § 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

注：本报告期，本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

注：本报告期，本基金管理人不存在申购、赎回或交易本基金的情况。

## § 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

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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、中国证监会批准设立东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：  
[www.dfham.com](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2021 年 10 月 27 日