

安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金
金
2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 21 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信浩盈 6 个月持有混合
基金主代码	010408
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 30 日
报告期末基金份额总额	840,553,787.95 份
投资目标	本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	资产配置策略方面，本基金的资产配置策略以基于宏观、政策及市场分析的定性研究为主，同时结合定量分析的方法，对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。股票投资策略方面，本基金的股票投资将在行业研究的基础上，通过自上而下和自下而上相结合的方法，在充分研究公司商业模式、竞争优势、公司成长空间、行业竞争格局的背景下，结合估值水平，注重安全边际，选择内在价值被低估的股票构建投资组合。债券投资策略方面，通过分析判断宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，在确保资产收益安全性和稳定性的基础上，构造债券组合。衍生品投资策略方面，本基金在严格遵守相关法律法规情况下，合理利用股指期货等衍生工具做套保或套利投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%+中债综合指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和

	货币市场基金，但低于股票型基金。 本基金通过港股通投资于香港证券市场，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	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§ 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 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-2,438,538.59
2. 本期利润	4,221,770.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0051
4. 期末基金资产净值	886,418,265.05
5. 期末基金份额净值	1.0546

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。

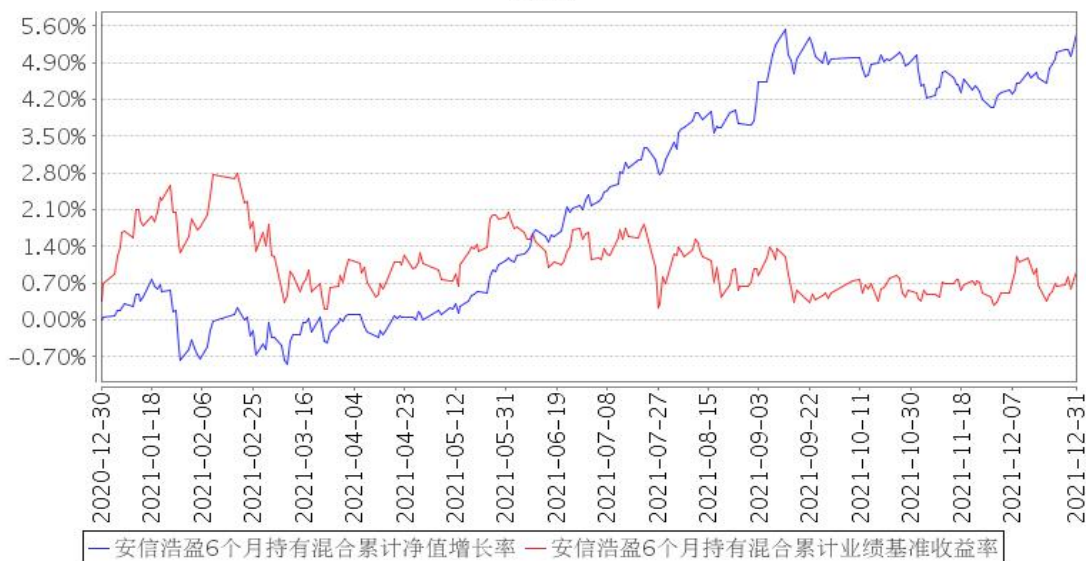
3.2 基金净值表现

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

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	0.46%	0.13%	0.41%	0.15%	0.05%	-0.02%
过去六个月	3.10%	0.16%	-0.70%	0.20%	3.80%	-0.04%
过去一年	5.41%	0.17%	0.24%	0.22%	5.17%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	5.46%	0.17%	0.93%	0.22%	4.53%	-0.05%

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

安信浩盈6个月持有混合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、本基金基金合同生效日为 2020 年 12 月 30 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		
张竞	本基金的基金经理，权益投资部总经理	2021 年 4 月 7 日	-	14 年	张竞先生，经济学硕士。历任华泰证券股份有限公司研究所研究员，安信证券股份有限公司证券投资部投资经理助理、安信基金筹备组研究部研究员，安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产管理部副总经理、特定资产管理部总经理。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部总经理。曾任安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信平稳合盈一年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。
潘巍	本基金的基金经理	2020 年 12 月 30 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

					<p>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。</p>
--	--	--	--	--	--

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》、《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

本报告期内，公司旗下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% 的交易共 1 次，为不同基金经理管理的基金因投资策略和流动性需要而发生的反向交易，有关基金经理履行了内部审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

随着大宗商品政府保供稳价、同时地产端民企剧烈出清，经济重回降速预期。但从 12 月以来，很多影响经济的因素已经在朝着积极的方向发生变化。一方面，宏观和结构政策已经明显转向积极，稳增长回归重要地位。中央经济工作会议对稳增长提出了明确要求。另一方面，新冠疫情的影响有所减小。尽管四季度以来，疫情也时有发生，但对经济的影响没有像 7-8 月份那么大，消费增速已经有所回升。

四季度以沪深 300（上涨 1.52%），上证 50（上涨 2.42%）为代表的大盘成长指数小幅上涨，而中小市值为代表的中小指数明显上涨，比如中证 1000 上涨 8.17%，国证 2000 上涨 11.39%，行业之间有所均衡。

展望 2022 年，经济方面，经济进入高质量发展阶段，传统周期行业融资以稳为主，新兴产业、制造业融资需求目前尚未对传统周期行业形成替代，数据上体现为经济活力偏弱，考虑到产业升级的需要，预计政策不会收紧。

货币政策方面，疫情过后，全球经济体均不同程度采用了宽货币的政策，经济复苏程度不同，国内相对领先，美国好于欧日；2022 年上半年，预期国内将维持总量宽松的政策，由宽货币向宽信用进行引导，促进制造业投资和国内消费。

我们认为 2022 年整体没有大的系统性风险，结构性机会犹存，行业分化趋于均衡。在股票策略方面，我们继续坚持自下而上精选个股的策略，同时坚持持有不受同一因素驱动的多个行业，即使再看好的单一行业，也不进行过多的风险暴露。长期通过坚持从个股研究的阿尔法中不断获得超额回报。在债券策略方面，继续以中高等级信用债为主，保证组合资产的流动性和变现能力。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0546 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.46%，业绩比较基准收益率为 0.41%。

4.6 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	119,490,276.93	13.10
	其中：股票	119,490,276.93	13.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	768,142,135.67	84.22
	其中：债券	768,142,135.67	84.22
	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	6,986,431.63	0.77
8	其他资产	17,423,726.97	1.91
9	合计	912,042,571.20	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 1,295,180.60 元，占净值比例 0.15%。

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	3,773,300.00	0.43
C	制造业	32,332,136.27	3.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,648,470.00	3.34
E	建筑业	8,888,000.00	1.00
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	3,223,882.39	0.36
J	金融业	-	-
K	房地产业	40,299,790.00	4.55
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	29,517.67	0.00
S	综合	-	-
	合计	118,195,096.33	13.33

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（%）
原材料	1,295,180.60	0.15
合计	1,295,180.60	0.15

以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	600900	长江电力	1,306,100	29,648,470.00	3.34
2	600048	保利发展	1,327,000	20,741,010.00	2.34
3	002648	卫星化学	342,500	13,710,275.00	1.55
4	001979	招商蛇口	743,200	9,914,288.00	1.12
5	600383	金地集团	743,600	9,644,492.00	1.09
6	601668	中国建筑	1,777,600	8,888,000.00	1.00
7	603501	韦尔股份	14,900	4,630,473.00	0.52
8	600519	贵州茅台	2,100	4,305,000.00	0.49
9	601899	紫金矿业	389,000	3,773,300.00	0.43
10	603986	兆易创新	12,900	2,268,465.00	0.26

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	46,350,868.30	5.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	36,690,990.50	4.14
	其中：政策性金融债	16,213,737.00	1.83
4	企业债券	409,079,096.80	46.15
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	137,399,500.00	15.50
7	可转债（可交换债）	58,020,648.07	6.55
8	同业存单	77,717,000.00	8.77
9	地方政府债	2,884,032.00	0.33
10	其他	-	-
11	合计	768,142,135.67	86.66

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	200011	20 付息国债 11	320,000	32,073,600.00	3.62
2	155776	19 东风 03	300,000	30,195,000.00	3.41
3	112962	19 深建 01	300,000	30,156,000.00	3.40
4	112103049	21 农业银行 CD049	300,000	29,187,000.00	3.29
5	112108033	21 中信银行 CD033	300,000	29,112,000.00	3.28

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

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原则，以套期保值、对冲投资组合的系统性风险为目的，优先选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。基于本基金的个股精选配置，在系统性风险积累较大时，通过适当的股指期货头寸对冲系统性风险，力争获取个股的超额收益和对冲组合的绝对收益。

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

本基金的国债期货投资根据风险管理原则，以套期保值为目的，以对冲风险为主。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，力求实现资产的长期稳定增值。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 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

报告期内本基金投资的前十名证券除 19 深建 01（证券代码：112962 SZ）、21 农业银行 CD049（证券代码：112103049 CY）、长江电力（证券代码：600900 SH）、21 中信银行 CD033（证券代码：112108033 CY）外其他证券的发行主体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。

2021 年 4 月 23 日、2020 年 12 月 8 日，深圳市特区建设发展集团有限公司因未依法履行职责被深圳市交通运输局罚款 0.5 万元【深交罚决第 ZD094939 号、深交罚决第 ZD094992 号】。

2021 年 7 月 20 日，深圳市特区建设发展集团有限公司因未按时披露定期报告被深圳证监局警示。

2021 年 8 月 19 日，深圳市特区建设发展集团有限公司因未依法履行职责，未及时披露公司重大事件，未按时披露定期报告被中国银行间市场交易商协会通报批评【《银行间债券市场自律处分决定书》（[2021]31 号）】。

2021 年 8 月 30 日，深圳市特区建设发展集团有限公司因未按时披露定期报告被通报批评，通知整改。

2021 年 10 月 9 日，深圳市特区建设发展集团有限公司因涉嫌违反法律法规被深圳市龙岗区水务局罚款 2.5 万元【深龙水罚（2021）018 号】。

2021 年 12 月 16 日，深圳市特区建设发展集团有限公司因未依法履行职责被深圳市交通运输局罚款 0.5 万元【深交罚决第[2021]ZD10039 号】。

2021 年 1 月 4 日，中国农业银行股份有限公司因环境污染被浙江省温岭市综合行政执法局罚款 500 万元，责令改正【台温综执（2020）罚决字第 03-0006 号】。

2021 年 1 月 29 日，中国农业银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被银保监会罚款 420 万

元【银保监罚决字（2021）1 号】。

2021 年 6 月 21 日，中国农业银行股份有限公司被人民银行监管（约见）谈话。

2021 年 12 月 14 日，中国农业银行股份有限公司因违规经营被银保监会罚款 150 万元【银保监罚决字（2021）38 号】。

2021 年 7 月 8 日，中国长江电力股份有限公司因违规超比例增持被上海证券交易所警示【上证公监函（2021）0087 号】。

2021 年 3 月 19 日，中信银行股份有限公司因违规经营被银保监会中国银行保险监督管理委员会罚款 450 万元【银保监罚决字（2021）5 号】。

2021 年 11 月 20 日，中信银行股份有限公司因未依法履行职责被国家市场监督管理总局罚款 50 万元【国市监处罚（2021）79 号】。

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

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	53,763.10
2	应收证券清算款	5,676,525.39
3	应收股利	-
4	应收利息	10,622,744.42
5	应收申购款	1,070,694.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,423,726.97

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	110059	浦发转债	16,972,672.50	1.91
2	132008	17 山高 EB	11,624,800.00	1.31
3	127032	苏行转债	6,009,862.76	0.68
4	113042	上银转债	5,369,251.50	0.61
5	113037	紫银转债	3,992,854.30	0.45
6	128034	江银转债	3,381,294.15	0.38
7	132011	17 浙报 EB	2,236,383.00	0.25

8	128141	旺能转债	1,035,840.00	0.12
9	113033	利群转债	976,951.20	0.11
10	113051	节能转债	722,120.00	0.08
11	113039	嘉泽转债	632,080.00	0.07
12	127020	中金转债	620,450.00	0.07
13	110048	福能转债	505,080.00	0.06
14	128107	交科转债	498,892.80	0.06
15	132020	19 蓝星 EB	496,080.00	0.06
16	128129	青农转债	493,845.66	0.06
17	128130	景兴转债	385,740.00	0.04
18	113009	广汽转债	323,220.00	0.04
19	127018	本钢转债	236,340.00	0.03
20	123107	温氏转债	193,021.40	0.02
21	113505	杭电转债	186,690.00	0.02
22	113549	白电转债	142,060.00	0.02
23	123101	拓斯转债	72,272.10	0.01
24	127027	靖远转债	12,794.00	0.00
25	123111	东财转 3	1,681.80	0.00

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

报告期期初基金份额总额	627,858,034.01
报告期期间基金总申购份额	313,229,894.10
减：报告期期间基金总赎回份额	100,534,140.16
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	840,553,787.95

§ 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

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、中国证监会准予安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其它文件。

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

2022 年 1 月 21 日