

# 安信永泰定期开放债券型发起式证券投资 基金

## 2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 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：招商证券股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 20 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 19 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 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	安信永泰定开债券
基金主代码	005479
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 28 日
报告期末基金份额总额	483,180,518.79 份
投资目标	本基金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	本基金兼顾资产的流动性和收益特征，通过严谨的大类资产配置和个券精选控制风险，运用多样化的投资策略实现基金资产稳定增值，力争获取高于业绩基准的投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*20%+中债总指数（全价）收益率*80%
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，属于中低风险/收益的产品。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

## § 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（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	3,767,462.34
2. 本期利润	9,440,777.61

3. 加权平均基金份额本期利润	0.0195
4. 期末基金资产净值	550,175,766.15
5. 期末基金份额净值	1.1387

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	1.75%	0.35%	1.31%	0.28%	0.44%	0.07%
过去六个月	-2.42%	0.39%	-1.95%	0.30%	-0.47%	0.09%
过去一年	-4.05%	0.42%	-1.36%	0.26%	-2.69%	0.16%
过去三年	3.96%	0.29%	7.01%	0.25%	-3.05%	0.04%
自基金合同 生效起至今	13.87%	0.27%	11.75%	0.26%	2.12%	0.01%

#### 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

安信永泰定开债券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 2017 年 12 月 28 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		
梁冰哲	本基金的基金经理	2021 年 8 月 30 日	-	6 年	梁冰哲先生，理学硕士。曾任德勤华永会计师事务所审计部审计员，安信基金管理有限责任公司固定收益研究部研究员，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。曾任安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金的基金经理助理；现任安信鑫日享中短债债券型证券投资基金的基金经理助理，安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
袁玮	本基金的基金经理	2021 年 12 月 29 日	-	12 年	袁玮先生，理学博士。历任安信证券股份有限公司安信基金筹备组研究员，安信基

					<p>金管理有限责任公司研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信新起点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、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
王涛	本基金的基金经理	2022年6月23日	-	19年	<p>王涛先生，经济学硕士，CFA、FRM。历任中国工商银行股份有限公司深圳分行资金运营部交易员、招商银行股份有限公司金融市场部交易员、东莞证券有限责任公司深圳分公司投资经理、融通基金管理有限公司基金经理、安信基金管理有限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。曾任安信尊享添益债券型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；现任安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信尊享添利率债债券型证券投资基金、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、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金的基金经理。</p>
钟光正	本基金的基金经	2018年12月4日	2022年6月23日	18年	<p>钟光正先生，经济学硕士。历任广东发展银行总行资金部交易员，招商银行股份有限公司</p>

	理, 固定收益投资总监			限公司总行资金交易部交易员, 长城基金管理有限公司总经理助理兼固定收益部总经理, 安信基金管理有限责任公司固定收益投资总监。曾任安信睿享纯债债券型证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、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

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

从全球宏观层面来看，俄乌冲突之后导致的全球能源品和农产品供给紧张的格局是影响市场的重要因素。能源品和农产品价格持续大幅上涨，各个主要经济体的通胀水平几乎都创了数十年的新高。在通胀高企的背景下，各国央行货币政策的目标普遍转向为控制通胀，而市场担忧央行控制通胀的目标可能会对经济有所损害。在此背景下，全球投资者的风险偏好似乎有所下降，避险情绪升温。

二季度由于疫情在一些核心城市反复出现，对国内经济造成了较大的冲击。在此背景之下，货币政策进一步宽松，社融数据再次高增，使得市场资金比较充裕，但结构上以短期信贷为主，因此对二级市场构成了流动性层面的利好。市场在经历过一季度的大幅下跌之后，迎来了强劲反弹，前期跌幅较大而基本面预期相对较好的板块出现了明显的上涨。尤其是在上海疫情逐步得到控制的 5、6 月份，在复工复产的预期下，在一系列促消费政策的刺激下，以新能源汽车为代表的消费、出行等板块涨幅明显。与此同时，前期表现抗跌的防御性板块，例如地产、银行、建筑等板块表现低迷。

在我们的整体框架下，尽管四月下旬成长性板块调整到了一个初步具备投资吸引力的估值水平，但依然缺乏足够的安全边际来确保我们做较大仓位的投资。我们在地产行业表现较好的阶段做了小幅的减仓，并且配置了少量的成长性与估值匹配的消费、成长类股票，但总体仓位结构变化并不明显，因而在整个市场反弹过程中，我们是明显落后于市场的。组合债券部分主要持有偏短久期的利率债资产，同时持有一些可转债资产作为收益增强。

#### 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 1.1387 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.75%，同期业绩比较基准收益率为 1.31%。

#### 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	96,353,674.15	16.81
	其中：股票	96,353,674.15	16.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	450,156,025.12	78.51

	其中：债券	450,156,025.12	78.51
	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	15,000,000.00	2.62
	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	9,098,687.73	1.59
8	其他资产	2,738,259.40	0.48
9	合计	573,346,646.40	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

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	1,372,464.00	0.25
C	制造业	27,087,598.33	4.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,136,914.00	1.12
E	建筑业	13,666,868.16	2.48
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	1,652,400.00	0.30
J	金融业	14,239,625.02	2.59
K	房地产业	32,197,804.64	5.85
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	96,353,674.15	17.51

### 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港股通股票。

## 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

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	600383	金地集团	830,772	11,165,575.68	2.03
2	601668	中国建筑	1,924,338	10,237,478.16	1.86
3	600048	保利发展	563,001	9,829,997.46	1.79
4	000002	万科A	370,157	7,588,218.50	1.38
5	601166	兴业银行	218,400	4,346,160.00	0.79
6	600036	招商银行	100,700	4,249,540.00	0.77
7	600585	海螺水泥	119,300	4,208,904.00	0.77
8	601985	中国核电	580,900	3,984,974.00	0.72
9	001979	招商蛇口	269,100	3,614,013.00	0.66
10	601186	中国铁建	434,100	3,429,390.00	0.62

### 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	123,993,269.54	22.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	161,468,572.60	29.35
	其中：政策性金融债	161,468,572.60	29.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	164,694,182.98	29.93
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	450,156,025.12	81.82

### 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	220201	22 国开 01	900,000	90,951,928.77	16.53
2	019666	22 国债 01	823,200	83,243,901.04	15.13
3	220205	22 国开 05	500,000	50,183,082.19	9.12
4	110059	浦发转债	258,010	27,348,741.90	4.97
5	113042	上银转债	239,950	25,212,815.28	4.58

### 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。基金管理人将以套期保值为目的，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

报告期内本基金投资的前十名证券除 22 国开 01（代码：220201 CY）、22 国开 05（代码：220205 CY）、浦发转债（代码：110059 SH）、上银转债（代码：113042 SH）、21 进出 12（代码：210312 CY）、中信转债（代码：113021 SH）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。

#### 1. 国家开发银行

2022 年 3 月 25 日，国家开发银行因未依法履行职责被中国银行保险监督管理委员会处以罚款。

#### 2. 上海浦东发展银行股份有限公司

2021 年 7 月 16 日，上海浦东发展银行股份有限公司因逾期未履行行政义务，内部制度不完善，违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款。

2021 年 11 月 15 日，上海浦东发展银行股份有限公司因提供虚假资料证明文件被国家外汇管

理局上海市分局罚款。

2022 年 3 月 25 日，上海浦东发展银行股份有限公司因违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款。

3. 上海银行股份有限公司

2021 年 7 月 12 日，上海银行股份有限公司因违规经营被中国银行保险监督管理委员会上海监管局通知整改并处以罚款。

2021 年 11 月 30 日，上海银行股份有限公司因未依法履行职责被中国银行保险监督管理委员会上海监管局罚款。

2022 年 2 月 23 日，上海银行股份有限公司因违规提供担保及财务资助被中国银行保险监督管理委员会上海监管局通知整改并处以罚款。

4. 中国进出口银行

2021 年 7 月 16 日，中国进出口银行因违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款并没收违法所得。

2022 年 3 月 25 日，中国进出口银行因违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款。

5. 中信银行股份有限公司

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。

2022 年 3 月 25 日，中信银行股份有限公司因违规提供担保及财务资助被中国银行保险监督管理委员会罚款。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 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	232,547.52
2	应收证券清算款	2,505,711.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,738,259.40

#### 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	110059	浦发转债	27,348,741.90	4.97
2	113042	上银转债	25,212,815.28	4.58
3	113044	大秦转债	24,126,919.52	4.39
4	113021	中信转债	15,338,342.03	2.79
5	118003	华兴转债	9,073,846.11	1.65
6	113025	明泰转债	5,904,541.62	1.07
7	132018	G 三峡 EB1	5,352,107.07	0.97
8	127030	盛虹转债	2,814,352.87	0.51
9	110053	苏银转债	2,777,847.52	0.50
10	128139	祥鑫转债	2,728,366.16	0.50
11	128025	特一转债	2,703,653.96	0.49
12	128122	兴森转债	2,591,379.84	0.47
13	113618	美诺转债	2,188,935.87	0.40
14	123064	万孚转债	2,179,066.22	0.40
15	110056	亨通转债	2,122,108.44	0.39
16	128145	日丰转债	2,025,748.02	0.37
17	123105	拓尔转债	1,613,008.01	0.29
18	113599	嘉友转债	1,524,992.38	0.28
19	127022	恒逸转债	1,443,699.14	0.26
20	110075	南航转债	1,375,996.75	0.25

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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

报告期期初基金份额总额	483,180,527.22
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	8.43
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	483,180,518.79

### § 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

本报告期期内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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金发起资金持有期限已满三年，截至本报告期末，发起资金未持有本基金份额。

## § 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

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	20220401-20220630	483,179,782.57	-	-	483,179,782.57	100.00

#### 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。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

## 10.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

## 10.3 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 7 月 20 日