

# 安信平稳合盈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：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	安信平稳合盈一年持有混合
基金主代码	010707
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 1 日
报告期末基金份额总额	1,658,984,507.77 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	资产配置方面，本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，合理确定基金在股票、债券、金融衍生品等各类资产类别上的投资比例，并进行动态调整。股票投资方面，本基金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。债券投资方面，本基金将采取自上而下的投资策略，通过深入分析宏观经济、货币政策、利率水平、物价水平以及风险偏好的变化趋势，从而确定债券的配置数量与结构。此外，本基金还将合理利用股指期货等衍生工具进行投资，并适当投资于资产支持证券。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×10%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%+中债总指数（全价）收益率×85%
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	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信平稳合盈一年持有混合 A	安信平稳合盈一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	010707	010708
报告期末下属分级基金的份额总额	1,611,509,309.59 份	47,475,198.18 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）	
	安信平稳合盈一年持有混合 A	安信平稳合盈一年持有混合 C
1. 本期已实现收益	16,772,657.29	469,155.83
2. 本期利润	7,059,624.46	183,567.02
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0044	0.0039
4. 期末基金资产净值	1,633,735,082.39	48,066,456.71
5. 期末基金份额净值	1.0138	1.0125

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

安信平稳合盈一年持有混合 A

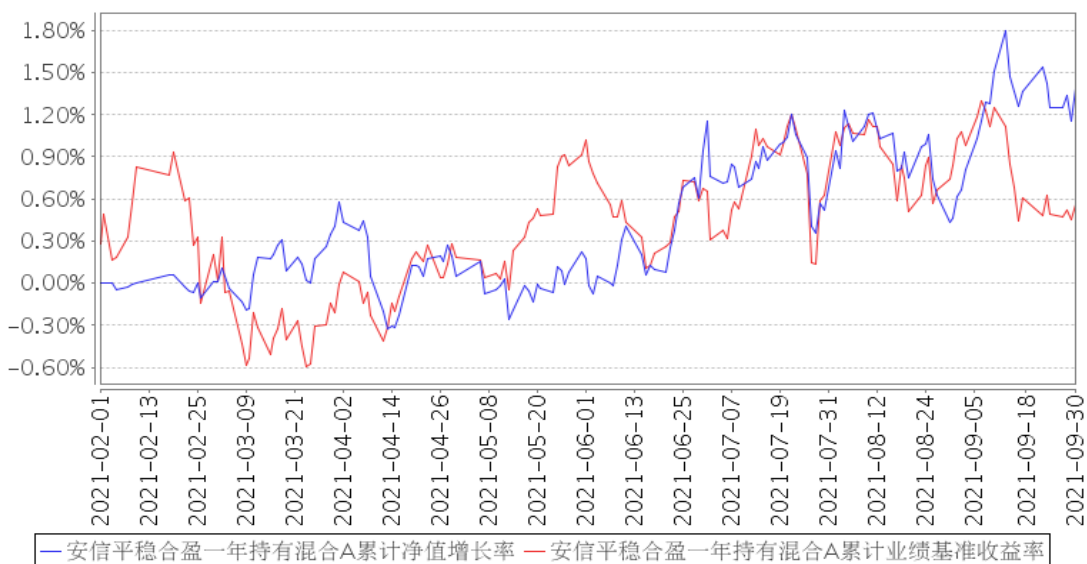
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.44%	0.18%	-0.11%	0.19%	0.55%	-0.01%
过去六个月	0.98%	0.16%	0.76%	0.16%	0.22%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.38%	0.14%	0.56%	0.18%	0.82%	-0.04%

安信平稳合盈一年持有混合 C

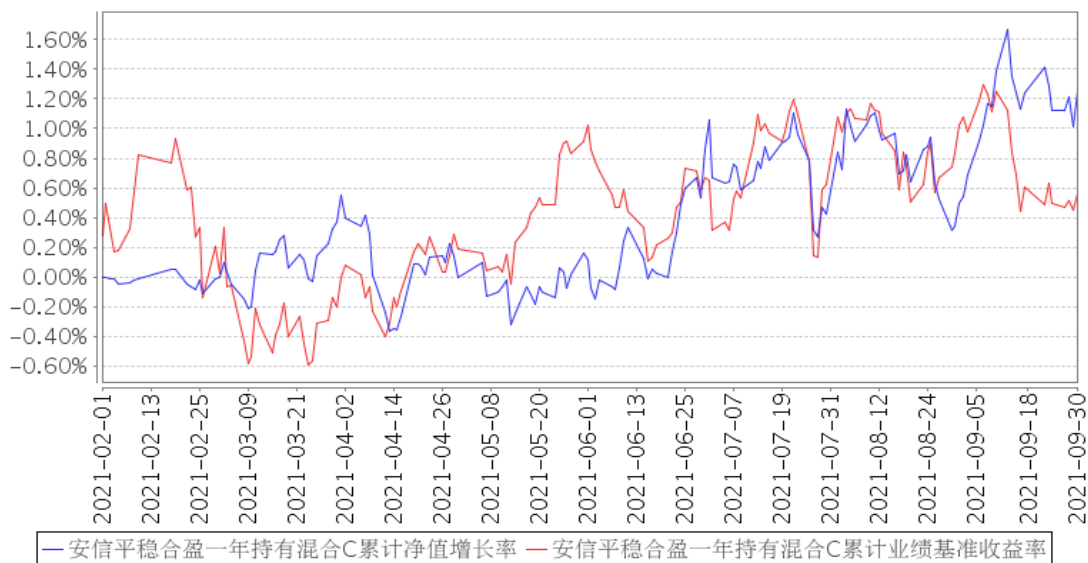
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.39%	0.18%	-0.11%	0.19%	0.50%	-0.01%
过去六个月	0.88%	0.16%	0.76%	0.16%	0.12%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.25%	0.14%	0.56%	0.18%	0.69%	-0.04%

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

安信平稳合盈一年持有混合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



安信平稳合盈一年持有混合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、本基金合同生效日为 2021 年 2 月 1 日，截止至报告期末本基金合同生效未满一年。

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 2 月 1 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。
庄园	本基金的基金经理	2021 年 2 月 1 日	-	17 年	庄园女士，经济学硕士。历任招商基金管理有限公司投资部交易员，工银瑞信基金

				<p>管理有限公司投资部交易员、研究部研究员，中国国际金融有限公司资产管理部高级经理，安信证券股份有限公司证券投资部投资经理、资产管理部高级投资经理，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。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金的基金经理助理，安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信价值精选股票型证券投资基金的基金经理助理，安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期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

三季度以来资金市场整体处于窄幅波动状态，利率债受降准、疫情导致的避险情绪升温等因素的影响持续下行，收益率绝对水平回落到历史低位，国开和国债利差进一步缩窄。信用债收益率下行幅度小于同期限国债，信用利差有所走阔。

权益方面，受限电、能耗双控等政策影响，经济复苏动能有所减弱，上游周期品价格持续抬升。地产行业销售与投资明显转弱，行业下行压力较大。三季度采掘、公用事业、钢铁、有色等行业涨幅居前，医药、纺织服装、食品饮料等行业涨幅靠后。

本基金以高评级债券为主，三季度维持低久期高流动性的组合结构；权益方面，相对均衡地配置了有色、电子、计算机等行业。

### 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 1.0138 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.44%；截至本报告期末本基金 C 类基金份额净值为 1.0125 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.39%；同期业绩比较基准收益率为-0.11%。

### 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	262,045,249.65	15.57
	其中：股票	262,045,249.65	15.57

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,373,787,312.00	81.61
	其中：债券	1,373,787,312.00	81.61
	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	10,000,000.00	0.59
	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	21,622,799.97	1.28
8	其他资产	15,859,147.80	0.94
9	合计	1,683,314,509.42	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 3,237,237.84 元，占净值比例 0.19%。

## 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	22,198,000.00	1.32
C	制造业	123,153,029.83	7.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	83,087,575.22	4.94
E	建筑业	20,183.39	0.00
F	批发和零售业	1,878,632.98	0.11
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	28,371,891.45	1.69
J	金融业	16,153.90	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,194.84	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	41,397.58	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,952.62	0.00
S	综合	-	-
	合计	258,808,011.81	15.39



### 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	3,237,237.84	0.19
合计	3,237,237.84	0.19

注：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	3,490,350	76,787,700.00	4.57
2	002415	海康威视	996,000	54,780,000.00	3.26
3	600570	恒生电子	467,800	26,795,584.00	1.59
4	002648	卫星石化	623,700	24,343,011.00	1.45
5	601899	紫金矿业	2,200,000	22,198,000.00	1.32
6	600438	通威股份	328,800	16,749,072.00	1.00
7	000063	中兴通讯	386,100	12,791,493.00	0.76
8	600905	三峡能源	907,763	6,299,875.22	0.37
9	600171	上海贝岭	122,859	4,395,895.02	0.26
10	002203	海亮股份	365,400	4,158,252.00	0.25

#### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	523,721,000.00	31.14
	其中：政策性金融债	503,767,000.00	29.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	390,777,000.00	23.24
6	中期票据	130,923,000.00	7.78
7	可转债（可交换债）	17,263,312.00	1.03
8	同业存单	311,103,000.00	18.50
9	其他	-	-
10	合计	1,373,787,312.00	81.69

### 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	112110108	21 兴业银行 CD108	1,500,000	145,755,000.00	8.67
2	101900895	19 中石油 MTN004	1,300,000	130,923,000.00	7.78
3	012101651	21 中航集 SCP001	1,000,000	100,270,000.00	5.96
4	042100250	21 电网 CP005	1,000,000	100,200,000.00	5.96
5	012102258	21 南电 SCP010	1,000,000	100,180,000.00	5.96

### 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长江电力（证券代码：600900 SH）、19 中石油 MTN004（证券代码：101900895 CY）、17 农发 09（证券代码：170409 CY）、21 进出 01（证券代码：210301 CY）、19 进出 06（证券代码：190306 CY）、21 电网 CP005（证券代码：042100250 CY）、21 南电 SCP010（012102258 CY）、21 兴业银行 CD108（112110108 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 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 1 月 19 日，中国石油天然气集团有限公司因涉嫌违反法律法规被武山县市场监管局罚款【（天武）市监行罚[2020]124 号】。

2021 年 4 月 12 日，中国农业发展银行因未依法履行职责被乌审旗住房和城乡建设局罚款人民币 2479.3 元【乌住建罚决字（2021）002 号】。

2021 年 7 月 16 日，中国进出口银行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 7345.6 万元，没收违法所得【银保监罚决字（2021）31 号】。

2021 年 7 月 1 日，国家电网有限公司因未依法履行职责被国家能源局通知整改。

2021 年 7 月 1 日，中国南方电网有限责任公司因未依法履行职责被国家能源局责令改正。

2021 年 1 月 13 日，兴业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消保局协会通报批评【银保监消保发（2021）2 号】。

2021 年 1 月 15 日，兴业银行股份有限公司因未依法履行职责被中国银行间市场交易商协会通报批评、通知整改。

2021 年 7 月 7 日，兴业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消保局协会通报批评【银保监消保发（2021）12 号】。

2021 年 7 月 21 日，兴业银行股份有限公司因违规经营被国家外汇管理局福建省分局警告、通知整改、没收违法所得、罚款 300.11 万元【闽汇罚（2021）5 号】。

2021 年 8 月 20 日，兴业银行股份有限公司因违规经营被中国人民银行罚款 5 万元【银罚字（2021）26 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	152,679.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,706,184.95
5	应收申购款	283.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,859,147.80

### 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	113011	光大转债	6,832,200.00	0.41
2	110047	山鹰转债	3,949,909.80	0.23
3	110063	鹰 19 转债	3,947,896.60	0.23

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	6,299,875.22	0.37	新股锁定

### 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

项目	安信平稳合盈一年持有混合 A	安信平稳合盈一年持有混 合 C
报告期期初基金份额总额	1,610,583,944.74	47,392,195.95
报告期期间基金总申购份额	925,364.85	83,002.23
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	1,611,509,309.59	47,475,198.18

## § 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平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信平稳合盈一年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

2021 年 10 月 26 日