

安信永盈一年定期开放债券型发起式证券  
投资基金  
2024 年第 3 季度报告

2024 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：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	安信永盈一年定开债券
基金主代码	011029
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 25 日
报告期末基金份额总额	699,999,181.94 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	封闭期内，本基金将综合采用债券类属配置策略、久期投资策略、信用选择策略、个券挖掘策略、息差策略、资产支持证券投资策略和国债期货投资策略，对宏观经济周期、市场利率走势、资金供求变化，以及信用债券的信用风险等因素进行分析，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。 在开放期内，本基金在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的品种，通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值波动。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率
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。 根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。

基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司

### § 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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	6,539,779.41
2. 本期利润	-393,362.48
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0006
4. 期末基金资产净值	776,756,483.22
5. 期末基金份额净值	1.1097

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。

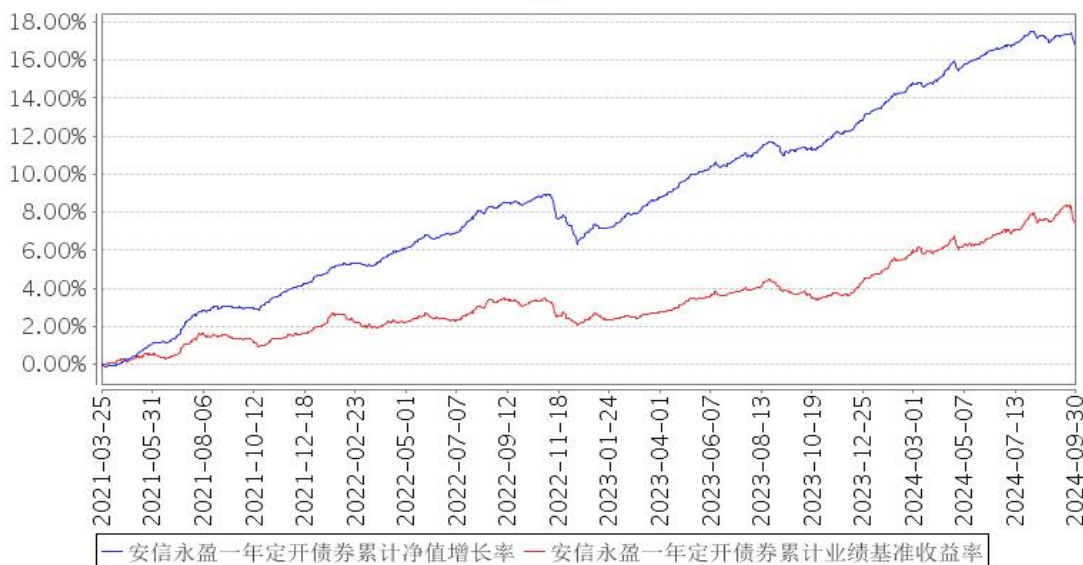
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-0.05%	0.08%	0.26%	0.10%	-0.31%	-0.02%
过去六个月	1.56%	0.07%	1.32%	0.09%	0.24%	-0.02%
过去一年	4.85%	0.05%	3.53%	0.07%	1.32%	-0.02%
过去三年	13.35%	0.05%	5.97%	0.06%	7.38%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	16.70%	0.05%	7.37%	0.06%	9.33%	-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

安信永盈一年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 2021 年 3 月 25 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	-	8 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。现任安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、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、安信楚盈一年持有期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

市场参与者对于未来国内经济景气度的评估仍然是影响大类资产表现最重要的因素。今年 7 月-8 月，受到天气原因、库存问题、短期经济结构转型等诸多因素的共同影响，这一时期市场参与者对于经济的信心偏弱，特别是对于当期经济的信心更弱。具体表现为商品市场出现较大幅度的下跌，长久期利率债持续上涨，受到短期经济周期影响较大的周期类股票出现了明显的调整。在市场普遍比较悲观的时刻，我们相对于市场要乐观一点，主要原因正如我们上次季报里所阐述的：我们认为市场容易将短期问题线性外推转化为对于经济长期悲观的理由，我们对此并不认可。我们一直认为目前经济的状态更多是周期性的原因，是 2020 年、2021 年经济繁荣周期之后出现的供需格局弱化所带来的结果，随着供需格局的改善，经济体自发具有再通胀的能力。如果能够在政策助推下更快实现再通胀，那当然是一件更好的事情。

9 月的政治局会议提出“要全面客观冷静看待当前经济形势，正视困难、坚定信心，切实增强做好经济工作的责任感和紧迫感”，从政策层面直面当前经济所面临的困难，有助于经济更快实现再通胀。政治局会议后，股票市场表现相对较好，债券市场表现相对较弱，反映了市场参与

者对于经济前景评估的改变。

2024 年三季度以来，债券市场呈现利率强、信用弱的特征，久期策略明显占优，以 30 年为代表的长端债券出现了明显的交易性机会，符合我们此前的判断。但考虑到目前长期国债交易比较拥挤，且隐含了对经济的悲观预期。组合从更长期的视角进行投资策略考量，仍然持有信用等级较好的信用债，获取稳定的票息回报。

#### 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 1.1097 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.05%，同期业绩比较基准收益率为 0.26%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,182,720,854.36	98.60
	其中：债券	1,182,720,854.36	98.60
	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	16,833,207.98	1.40
8	其他资产	5,900.91	0.00
9	合计	1,199,559,963.25	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

本基金本报告期末未持有股票。

##### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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	526,454,259.79	67.78
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	231,926,540.93	29.86
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	424,340,053.64	54.63
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,182,720,854.36	152.26

### 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	102102285	21 闽高速 MTN010	600,000	63,316,465.57	8.15
2	2320009	23 昆仑银行绿色债 01	600,000	61,630,510.68	7.93
3	232380008	23 广州农商行二级资本债 01	500,000	54,752,726.03	7.05
4	2021050	20 萧山农商二级 01	500,000	53,313,251.37	6.86
5	102282533	22 柯桥国资 MTN003	500,000	52,049,344.26	6.70

### 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

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。

### 5.9.2 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 23 昆仑银行绿色债 01（代码：2320009 CY）、23 广州农商行二级资本债 01（代码：232380008 CY）、20 萧山农商二级 01（代码：2021050 CY）、24 天津银行债 01（代码：212480015 CY）、22 成都农商二级 01（代码：2221010 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。

#### 1. 昆仑银行股份有限公司

2024 年 9 月 2 日，昆仑银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局克拉玛依监管分局罚款。

#### 2. 广州农村商业银行股份有限公司

2024 年 2 月 5 日，广州农村商业银行股份有限公司因未依法履行职责被国家金融监督管理总局广东监管局罚款。

2024 年 8 月 26 日，广州农村商业银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局广东监管局罚款。

#### 3. 浙江萧山农村商业银行股份有限公司

2024 年 8 月 16 日，浙江萧山农村商业银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总



局浙江监管局罚款。

4. 天津银行股份有限公司

2023 年 12 月 14 日,天津银行股份有限公司因违反反洗钱法被中国人民银行天津市分行警告、罚款。

5. 成都农村商业银行股份有限公司

2024 年 7 月 2 日,成都农村商业银行股份有限公司因违规经营被国家金融监督管理总局四川监管局罚款。

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	5,900.91
2	应收证券清算款	-
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	5,900.91

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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	699,999,181.94
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	-
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	699,999,181.94

## § 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 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	20240701-20240930	699,999,000.00	-	-	699,999,000.00	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盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信永盈一年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

2024 年 10 月 24 日