

安信睿享纯债债券型证券投资基金 2020 年 第 1 季度报告

2020 年 03 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 04 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 17 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 2020 年 01 月 08 日（基金合同生效日）起至 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	安信睿享纯债债券
基金主代码	008007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 01 月 08 日
报告期末基金份额总额	101,101,626.68 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	本基金将在保持较高流动性的基础上，尽可能提高净值的稳定性，并通过严谨的分析判断和多样化的投资策略，力争获取超越业绩比较基准的稳定回报。
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，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§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(2020年01月08日 - 2020年03月31日)
1. 本期已实现收益	848,243.46
2. 本期利润	1,350,227.90
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0081
4. 期末基金资产净值	101,982,713.15
5. 期末基金份额净值	1.0087

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。

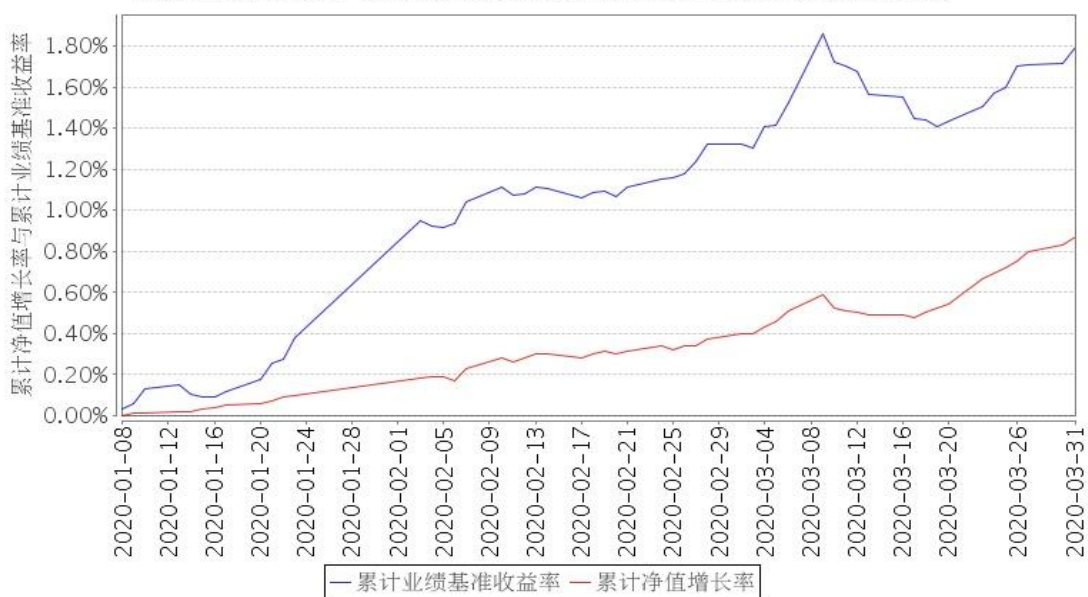
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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
自基金合同生效起至今	0.87%	0.03%	1.79%	0.10%	-0.92%	-0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

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 1 月 8 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。截止至报告期末，本基金仍处于建仓期。

§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		
潘巍	本基金的基金经理	2020 年 1 月 8 日	-	11 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。现任安信永鑫增强债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信睿享纯债债券型证券投资基金的基金经理。
钟光正	本基金的基金经理，固定收益投资总监兼固定收益部	2020 年 1 月 8 日	-	16 年	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总行资金交易部交易员，长城基金管理有限公司基金经理、总经理助理兼固定收益部总经理。现任安信基金管理有限

	总经理			负责公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理。现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、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、安信睿享纯债债券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。

4.2 管理人对报告期内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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度以来资金面整体维持宽松，通胀见顶回落的预期较强，并随着国内外疫情的发酵和蔓延，经济下行的压力剧增，经济衰退风险上升，世界各国大多采取了超常规的政策手段用于抵御金融风险。整个一季度，利率债收益率明显下行，信用债也有较好表现。

在本投资期内，债券投资以利率债为主，在资金宽松时增加了中短端债券资产。由于产品处于成立初期，组合的久期和杠杆从较低逐渐抬升，净值表现较为平稳。

4.4.2 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 1.0087 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.87%，同期业绩比较基准收益率为 1.79%。

4.5 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（人民币元）	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	94,358,594.30	92.18
	其中：债券	94,358,594.30	92.18
	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	5,923,575.31	5.79
8	其他资产	2,076,161.74	2.03
9	合计	102,358,331.35	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 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	84,591,594.30	82.95
	其中：政策性金融债	84,591,594.30	82.95
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）	-	-
8	同业存单	9,767,000.00	9.58
9	其他	-	-
10	合计	94,358,594.30	92.52

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	108605	国开 1901	215,170	21,818,238.00	21.39
2	108602	国开 1704	203,290	20,347,296.10	19.95
3	018081	农发 1901	151,140	15,135,159.60	14.84
4	018006	国开 1702	100,000	10,355,000.00	10.15
5	111912131	19 北京银行 CD131	100,000	9,767,000.00	9.58

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

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国开 1901（证券代码：108605 SZ）、国开 1704（证券代码：108602 SZ）、国开 1702（证券代码：018006 SH）、国开 1902（证券代码：018010 SH）、国开 1805（证券代码：108604 SZ）、国开 1803（证券代码：018009 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。

2020 年 1 月 10 日，国家开发银行内蒙古自治区分行因违规经营被内蒙古银保监局罚款 20 万元【内银保监罚决字（2019）38 号】。

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（人民币元）
1	存出保证金	19,399.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,056,762.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,076,161.74

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

基金合同生效日（2020 年 01 月 08 日）持有的基金份额	202,021,794.30
报告期期间基金总申购份额	7,369.03
减：报告期期间基金总赎回份额	100,927,536.65

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	101, 101, 626. 68

§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

本报告期末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

§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	20200108-2 0200226	50, 017, 472. 22	-	50, 017, 472. 22	-	-
	2	20200108-2 0200331	99, 999, 000. 00	-	-	99, 999, 000. 00	98. 91
	3	20200108-2 0200309	49, 999, 000. 00	-	49, 999, 000. 00	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

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睿享纯债债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《安信睿享纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信睿享纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信睿享纯债债券型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

2020 年 04 月 20 日