
信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划

2021年第2季度报告

2021年06月30日

基金管理人:信达证券股份有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2021年07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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7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05月12日起至2021年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	信达丰睿
基金主代码	970022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年05月12日
报告期末基金份额总额	54,966,641.73份
投资目标	本集合计划在控制信用风险、谨慎投资的前提下，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划通过密切跟踪分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定类属资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，挖掘价值被低估的标的券种。本集合计划采取的投资策略主要包括资产配置策略、固定收益类品种投资策略等。在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力争通过主动管理及利差挖掘实现资产的长期稳健增值。
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	本集合计划为债券型产品，其风险收益水平低于股票型、混合型基金，高于货币市场型基金，属于较低风险、较低收益的产品。

基金管理人	信达证券股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

§ 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05月12日 - 2021年06月30日）
1. 本期已实现收益	22,563.48
2. 本期利润	-118,972.31
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0034
4. 期末基金资产净值	53,900,784.22
5. 期末基金份额净值	0.9806

注：1、因本基金合同等法律文件于2021年05月12日生效，本报告期为2021年05月12日至2021年06月30日，详细信息请查阅相关公告。

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。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。

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
自基金合同生效起至今	-0.65%	0.04%	0.11%	0.03%	-0.76%	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



3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

§ 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		
薛宇	本基金的基金经理、基金经理	2021-05-12	2021-06-21	7	薛宇，中国人民大学财政金融学院财政学硕士，中级经济师。7年从业经验，曾任中国邮政储蓄银行金融市场部副处长。2013年8月加入信达证券，历任固定收益部副总经理、

					资产管理事业部固收投资经理；擅长研究宏观经济金融形势、财政货币政策、市场供求关系，经历多个完整经济周期，能够较好把握市场的运行节奏。
王琳	本基金的基金经理、基金经理	2021-06-21	-	4	王琳，北京大学经济学院硕士研究生。2020 年 6 月加入信达证券。具有多年债券从业经验，曾就职于华创证券固定收益部，有丰富的债券研究和交易经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
王琳	公募基金	1	53,900,784.22	2021-06-21
	私募资产管理计划	4	1,470,175,861.46	2020-12-11
	其他组合	-	-	-
	合计	5	1,524,076,645.68	-

注：本部分所述的“私募资产管理计划”均为拟按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更的证券公司大集合资产管理产品。

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，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无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

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部制定的公平交易制度，对于包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，形成了有效的公平交易执行体系。

本报告期内，管理人公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

债券市场方面，央行货币政策稳定当头，以及监管层对房地产领域实施“三道红线”以及严格管控地方政府隐性债务风险，稳货币+结构性紧信用的格局下，2季度债市收益率整体震荡下行，利率债和信用债收益率普遍下行，短端下行幅度大于长端，2季度10年国债200016收益率下行9bp至3.1%，10年国开210205收益率下行7bp至3.5%，同期1年国开和国债收益率分别下行15bp和25bp，利率债收益率曲线走陡，信用债收益率跟随利率债下行，1年、3年、5年、7年AA中短期票据收益率分别下行25.44BP、29.7BP、15.15BP、10.6BP，1年、3年、5年、7年AA城投债收益率分别下行11.31BP、18.36BP、33.51BP、26.6BP。

转债市场方面，中证转债指数上涨4.45%，沪深300指数涨幅3.48%，上证综指涨幅4.34%，深圳成指上涨10.04%，创业板指数涨幅2.08%，转债指数涨幅低于深圳成指，高于其他主要指数。

针对上述市场状况，管理人自本基金合同生效之日（2021年05月12日）以来，随着基金规模的增长，逐步建仓。债券方面，管理人通过配置短久期、高票息、信用风险可控的信用债组合来追求收益，以短期国债等资产来保持产品流动性；转债方面，配置了少量的到期收益率3%以上的偏债型银行转债。

展望未来，债券方面，当前10年国债收益率已经跌破今年1月份低点，接近5月低点，AA评级及以上信用债信用利差普遍在历史25%分位数以内，债券估值吸引力不足。PPI通胀风险尚未显著收敛、美联储Taper预期发酵、地方债供给可能提速均会对债市造成扰动，因此，管理人对债市短期持偏谨慎的态度，注重票息为主，注意提高组合流动性，保持短久期和低杠杆，严控信用风险，规避低评级、高信用风险主体。转债方面，未来可转债投资主要有两点，一是需要精选标的，在业绩高增长的个券和上市新券中寻找投资机会；二是控制可转债整体仓位，等待更具性价比的时机。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末信达丰睿基金份额净值为0.9806元，本报告期内，基金份额净值增长率为-0.65%，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

报告期内，信达丰睿于2021年05月12日合同变更生效，并于2021年05月18日开放申购、赎回。自合同生效日（2021年05月12日）至2021年06月09日，本基金出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人的情形。

管理人密切关注参公运作后本基金的申购、赎回情况，持续做好投资者服务工作，本基金自2021年05月18日开放申购、赎回之后，基金份额持有人数不断增加，自开放申购、赎回日（2021年05月18日）至报告期末，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人的情形。

§ 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	47,326,769.40	87.57
	其中：债券	47,326,769.40	87.57
	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	5,000,025.00	9.25
	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	703,822.77	1.30
8	其他资产	1,016,853.80	1.88
9	合计	54,047,470.97	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

本基金本报告期末无港股通投资股票。

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	21,002,550.00	38.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	250,719.40	0.47
	其中：政策性金融债	250,719.40	0.47
4	企业债券	4,990,000.00	9.26
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,080,000.00	3.86
8	同业存单	-	-
9	其他	19,003,500.00	35.26
10	合计	47,326,769.40	87.80

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	019640	20国债10	125,000	12,500,000.00	23.19
2	019654	21国债06	85,000	8,502,550.00	15.77
3	145635	17株高02	50,000	5,080,500.00	9.43
4	166263	20晋路01	50,000	4,995,000.00	9.27
5	163839	20津投S2	50,000	4,990,000.00	9.26

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金投资前十名证券的发行主体中，株洲高科集团有限公司报告期曾发生外部董事涉嫌严重违法违纪，正在接受株洲市天元区监察委员会监察调查。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。本基金投资的前十名证券发行主体，除上述主体外，本期没有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。

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

否。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,016,843.88
5	应收申购款	9.92
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,016,853.80

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	113021	中信转债	1,055,700.00	1.96
2	110059	浦发转债	1,024,300.00	1.90

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

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

基金合同生效日(2021年05月12日)基金份额总额	1,270,717.60
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	53,695,924.13
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	54,966,641.73

注：合同生效日：2021年05月12日

§ 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**

单位：份

基金合同生效日管理人持有的本基金份额	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	10,177,081.21
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,177,081.21
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	18.52

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2021-06-08	10,177,081.21	10,000,000.00	-
合计			-	-	

注：申购金额大于等于500万元，申购费为1000元/笔。

§ 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

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
产品特有风险						
本集合计划在报告期内不存在单一投资者持有份额达到或超过集合计划总份额20%的情况。						

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2021/05/28 信达证券股份有限公司关于信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划增加珠海盈米基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/05/28 信达证券股份有限公司关于信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划增加深圳市新兰德投资者咨询有限公司为代销机构的公告

2021/05/28 信达证券股份有限公司关于信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划增加京东肯特瑞基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/05/28 信达证券股份有限公司关于信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划增加济安财富（北京）基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/05/28 信达证券股份有限公司关于信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/05/28 信达证券股份有限公司关于信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划增加方德保险基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/05/28 信达证券股份有限公司关于信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划增加大连网金基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/06/04 信达证券股份有限公司关于信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/06/04 信达证券股份有限公司关于信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告

2021/06/09 信达证券股份有限公司关于信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划增加中国建设银行股份有限公司为代销机构的公告

2021/06/22 信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划基金经理变更公告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件
- 2、信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同
- 3、信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议
- 4、信达丰睿六个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书
- 5、管理人业务资格批复、营业执照
- 6、托管人业务资格批复、营业执照
- 7、报告期内披露的各项公告

9.2 存放地点

北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

9.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95321

公司网址：<https://www.cindasc.com>

信达证券股份有限公司

2021年07月21日