

# 泰信汇享利率债债券型证券投资基金

## 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

本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。

本基金的托管人华夏银行股份有限公司根据基金合同已于 2022 年 10 月 24 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为 2022 年 7 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	泰信汇享利率债债券	
基金主代码	013057	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 19 日	
报告期末基金份额总额	2,587,376.04 份	
投资目标	本基金在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，重点投资利率债券，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，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。本基金采取的投资策略主要包括久期策略、骑乘策略、期限结构配置策略、息差策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。	
业绩比较基准	中债-国债及政策性银行债指数收益率*80%+人民币活期存款收益率（税后）*20%	
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	泰信基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泰信汇享利率债债券 A	泰信汇享利率债债券 C
下属分级基金的交易代码	013057	013058
报告期末下属分级基金的份额总额	1,114,504.04 份	1,472,872.00 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）	
	泰信汇享利率债债券 A	泰信汇享利率债债券 C
1. 本期已实现收益	921,076.59	35,064.69
2. 本期利润	977,615.06	67,889.28
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0100	0.0114
4. 期末基金资产净值	1,147,220.43	1,578,386.58
5. 期末基金份额净值	1.0294	1.0716

注：1. 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。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人申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

泰信汇享利率债债券 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	1.37%	0.06%	0.50%	0.06%	0.87%	0.00%
过去六个月	1.77%	0.06%	0.52%	0.05%	1.25%	0.01%
过去一年	2.79%	0.08%	1.01%	0.05%	1.78%	0.03%
自基金合同生效起至今	2.94%	0.07%	1.01%	0.05%	1.93%	0.02%

泰信汇享利率债债券 C

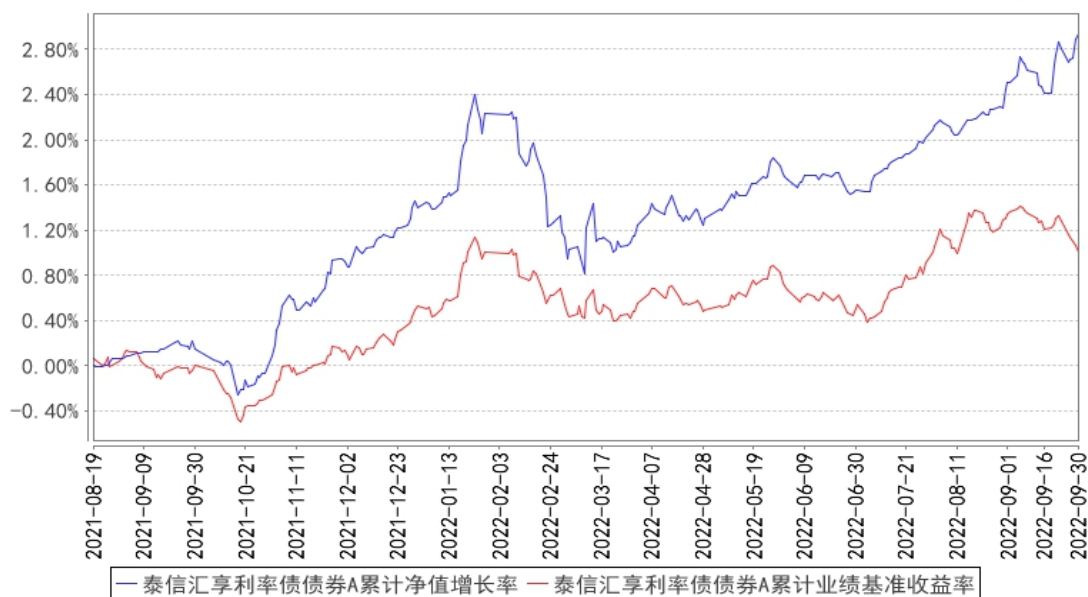
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.64%	0.07%	0.50%	0.06%	1.14%	0.01%
过去六个月	1.99%	0.07%	0.52%	0.05%	1.47%	0.02%
过去一年	2.89%	0.08%	1.01%	0.05%	1.88%	0.03%

自基金合同 生效起至今	7.16%	0.18%	1.01%	0.05%	6.15%	0.13%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

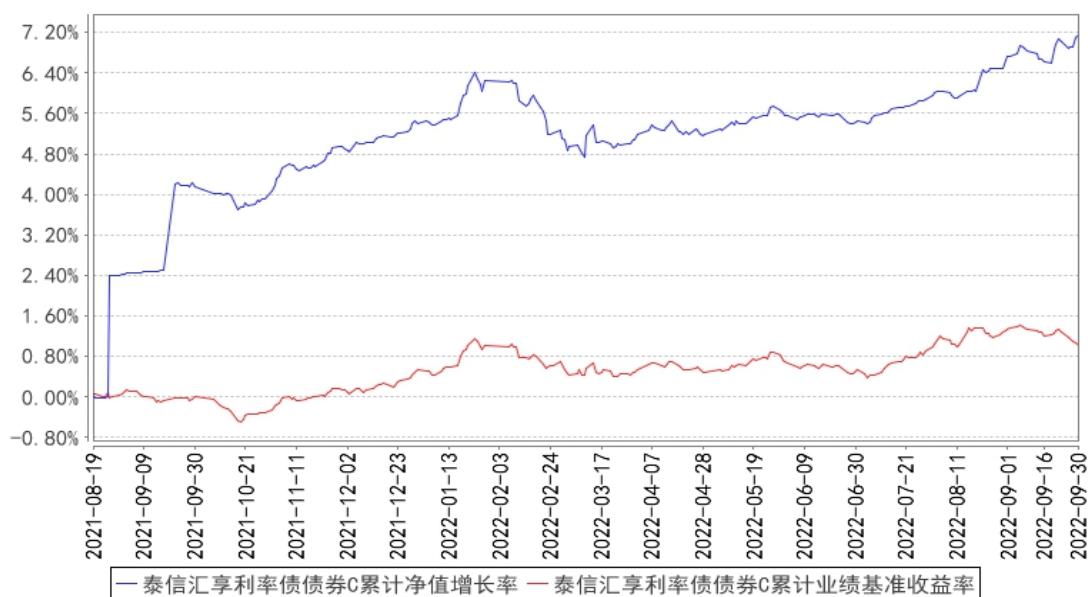
注：本基金业绩比较基准：中债-国债及政策性银行债指数收益率\*80%+人民币活期存款收益率（税后）\*20%

### 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

泰信汇享利率债债券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



泰信汇享利率债债券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、本基金基金合同于 2021 年 8 月 19 日生效。

2、建仓期满，各项投资比例符合基金合同关于投资组合的相关规定。基金的投资组合比例为：

本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于利率债资产的比例不低于非现金基金资产的 80%，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金所指利率债是指国债、央行票据、政策性金融债。

## § 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		
张安格	泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理、泰信汇享利率债债券型证券投资基金基金经理、泰信添利 30 天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理、泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金经理、泰信汇盈债券型证券投资基金基金经理。	2021 年 8 月 19 日	-	7 年	张安格女士，硕士，具有基金从业资格。曾任职于申万宏源证券有限公司资产管理事业部，从事固定收益类产品的设计、交易、研究及投资。2020 年 12 月加入泰信基金管理有限公司拟任基金经理。2021 年 2 月至今任泰信鑫利混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至今任泰信汇享利率债债券型证券投资基金基金经理，2022 年 3 月任泰信添利 30 天持有期债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 3 月任泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金经理，2022 年 3 月任泰信汇盈债券型证券投资基金基金经理。
镇嘉	泰信增强收益债券型证券投资基金基金经理、	2021 年 8 月 19 日	-	12 年	镇嘉先生，上海财经大学西方经济学专业硕士，曾任职于兴业银行、汇丰银行。2010 年 6 月加入泰信基金管理有限公司，历任文秘、研究员、交易员、专户投资经理、基金经理助理、基金经理。2021 年 2 月

泰信汇享利率债债券型证券投资基金基金经理、泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理				至今任泰信增强收益债券型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至今任泰信汇享利率债债券型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至今任泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--

注：1、以上日期均是指公司公告的日期。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

本报告期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信汇享利率债债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证监会公告[2011]18号），公司制定了《公平交易制度》，适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为，公

平交易制度整体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格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，本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况，亦无其他异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，伴随着稳增长政策出台，开工需求回升，宏观经济逐渐改善。地产投资延续弱势，基建及制造业投资增速表现良好托底固定资产投资同比增速 8 月收于 5.8%，生产、内部订单、价格及库存等指标环比改善，推升 9 月制造业 PMI 收于 50.1%，回到荣枯线之上。3 季度疫情影响下，需求整体延续偏弱。出口高频指标压力加大。通胀整体可控，社融需求在财政推动下取得良好表现。3 季度海外加快加息步伐，国内央行下调公开市场操作利率 10 个基点，市场流动性合理充裕。

三季度，美元上行，人民币汇率阶段性承压，对国内股债市场造成阶段性压力。债券市场前半段前在流动性宽松、偏弱的基本面表现及央行宽松货币政策推动下取得较好表现，降息兑现后，10 年国债及国开债分别于 8 月 18 日，收于 2.58% 及 2.78% 的季度内低点，较半年末下行 24 及 27 个基点。随后市场受稳经济政策密集出台、月度经济边际改善、汇率下行及流动性的边际影响，收益率转而上行。季末，10 年国债及国开收于 2.76% 及 2.93%，较月内低点上行 18 和 15 个基点。中短端利率品种更多受到流动性和配置盘需求支撑，表现好于长债。国开债整体表现优于国债表现。

三季度，汇享利率债基金积极跟踪政策及基本面的表现，积极参与了利率债波段交易机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末泰信汇享利率债债券 A 基金份额净值为 1.0294 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.37%；截止本报告期末泰信汇享利率债债券 C 基金份额净值为 1.0716 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.64%；同期业绩比较基准收益率为 0.50%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金于 2022 年 8 月 22 日至 2022 年 9 月 30 日有连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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	2,517,123.39	32.34
	其中：债券	2,517,123.39	32.34
	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	1,445,615.90	18.57
8	其他资产	3,820,129.50	49.08
9	合计	7,782,868.79	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

报告期末本基金未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有股票。

## 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

报告期末本基金未持有股票。

## 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	2,517,123.39	92.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	其他	-	-
10	合计	2,517,123.39	92.35



**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	019679	22 国债 14	13,000	1,305,742.79	47.91
2	019638	20 国债 09	12,000	1,211,380.60	44.44

**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**

本报告期末本基金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**

本报告期末本基金未持有权证。

**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**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**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。

**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。

**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**

本基金本报告期投资的前十名证券中发行主体未发生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、处罚的情况。

**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**

本报告期末本基金未投资股票，不存在前十名股票超出基金合同规定备选库之外的情形。

**5.10.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,489.25

2	应收证券清算款	3,733,073.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	78,566.47
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,820,129.50

#### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金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

报告期末本基金未持有股票。

5.10.6 本报告涉及合计数相关比例的，均以合计数除以相关数据计算，而不是对不同比例进行合计。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰信汇享利率债债券 A	泰信汇享利率债债券 C
报告期期初基金份额总额	374,922,336.91	9,958,794.20
报告期期间基金总申购份额	1,073,347.07	1,267,516.03
减：报告期期间基金总赎回份额	374,881,179.94	9,753,438.23
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	1,114,504.04	1,472,872.00

## § 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

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

## § 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

投	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

资 者 类 别	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	20220707 – 20220728	68,951,832.15		-68,951,832.15	-	-
	2	20220707 – 20220821	49,794,115.04		-49,794,115.04	-	-
	3	20220822 – 20220928	14,773,859.94		-14,773,859.94	-	-
	4	20220822 – 20220929	14,773,859.94		-14,773,859.94	-	-
	5	20220930 – 20220930	-	973,325.58	-	973,325.58	37.62
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

## 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、中国证监会批准泰信汇享利率债债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信汇享利率债债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信汇享利率债债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信汇享利率债债券型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照

### 9.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。在支付必要的工本费后，投资者可在有效的工作时间内取得本报告及上述备查文件的复制件。

### 9.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站([www.ftfund.com](http://www.ftfund.com))查阅上述相关文件, 或拨打客户服务中心电话(400-888-5988, 021-38784566), 和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

2022 年 10 月 25 日