

人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金

2022年第2季度报告

2022年06月30日

基金管理人:中国人保资产管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2022年07月20日

目录

| | |
|--|----|
| §1 重要提示 | 3 |
| §2 基金产品概况 | 3 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 4 |
| 3.1 主要财务指标 | 4 |
| 3.2 基金净值表现 | 4 |
| §4 管理人报告 | 5 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 | 5 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 6 |
| 4.3 公平交易专项说明 | 6 |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 | 7 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现 | 7 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 | 7 |
| §5 投资组合报告 | 7 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况 | 7 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 8 |
| 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 | 8 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 | 8 |
| 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 | 8 |
| 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 | 9 |
| 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 | 9 |
| 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 | 9 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 9 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 9 |
| 5.11 投资组合报告附注 | 9 |
| §6 开放式基金份额变动 | 10 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 | 10 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 | 10 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 | 10 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息 | 10 |
| 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 | 10 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 10 |
| §9 备查文件目录 | 11 |
| 9.1 备查文件目录 | 11 |
| 9.2 存放地点 | 11 |
| 9.3 查阅方式 | 11 |

§ 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的法律责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年7月19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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 人保福泽一年定期开放债券 |
| 基金主代码 | 006461 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年12月12日 |
| 报告期末基金份额总额 | 12,228,561.16份 |
| 投资目标 | 在控制风险并保持资产流动性的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | <p>本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，结合定量分析方法，确定资产在非信用类固定收益类证券（国债、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，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投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性</p> |

| | |
|--------|--|
| | 的需求。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价（总值）指数收益率×80%+一年期银行定期存款利率(税后)×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 中国人保资产管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |

§ 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（2022年04月01日 - 2022年06月30日） |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 7,073.95 |
| 2. 本期利润 | 7,073.95 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0006 |
| 4. 期末基金资产净值 | 13,693,556.41 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.1198 |

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、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，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 |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.05% | 0.00% | 0.31% | 0.03% | -0.26% | -0.03% |
| 过去六个月 | 5.62% | 0.48% | 0.46% | 0.04% | 5.16% | 0.44% |
| 过去一年 | 8.02% | 0.34% | 1.77% | 0.04% | 6.25% | 0.30% |
| 过去三年 | 9.03% | 0.25% | 3.74% | 0.05% | 5.29% | 0.20% |
| 自基金合同 | 11.98% | 0.23% | 4.31% | 0.05% | 7.67% | 0.18% |

| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

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



注：1、本基金基金合同于2018年12月12日生效。根据基金合同规定，本基金建仓期为6个月，建仓期满，本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

2、本基金业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数收益率*80%+一年期银行定期存款利率(税后)*20%。

3、依据《人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》及《关于人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金最后运作日为2022年2月18日，于2022年2月19日进入清算期。

§ 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 | | |
| 朱锐 | 基金经理 | 2021-11-23 | - | 8年 | 北京大学金融学硕士。曾在中国农业银行总行资产管理部从事固定收益投资组合管 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>理，富国基金管理有限公司固定收益投资部工作，嘉实基金管理有限公司机构投资部任投资经理；2014年11月至2016年2月任富国基金管理有限公司基金经理，曾任富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金基金经理。2020年1月加入中国人保资产管理有限公司公募基金事业部，2020年6月3日至2021年6月26日任人保利璟纯债债券型证券投资基金（2021年6月26日已清盘）基金经理，2020年6月3日起任人保双利优选混合型证券投资基金、人保福睿18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，2020年7月8日起任人保纯债一年定期开放债券型证券投资基金、人保鑫盛纯债债券型证券投资基金、人保中高等级信用债债券型证券投资基金基金经理，2020年10月20日至2021年6月26日任人保鑫选双债债券型证券投资基金（2021年6月26日已清盘）基金经理，2021年11月23日起任人保鑫泽纯债债券型证券投资基金、人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2021年12月24日起任人保福欣3个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

- 1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为本基金合同生效日。
- 2、非首任基金经理，其“任职日期”为公告确定的聘任日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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运作管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在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

本基金管理人公平对待旗下所有公募基金投资组合，建立了公平交易制度和流程。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有公募基金投资组合，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年二季度，疫情形势从逐步恶化到开始缓解，防控措施也从收紧到逐步放松，经济增长信心和动能从5月底开始逐步好转，货币政策仍然维持在较为宽松的状态以支持实体经济，地产风险进一步得到化解，政策托底经济，发力稳增长的意愿强烈，社会融资总额同比继续好转。总体来讲，债市较为平稳，收益率变化不大。操作上，本基金仅持有待清算债券。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末人保福泽一年定期开放债券基金份额净值为1.1198元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.05%，同期业绩比较基准收益率为0.31%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金最后运作日为2022年2月18日，自2022年2月19日起，本基金进入清算期。本报告期，本基金处于清算期内。

§ 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 | 6,188,300.00 | 45.08 |
| | 其中：债券 | 6,188,300.00 | 45.08 |
| | 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 | 7,519,111.44 | 54.77 |
| 8 | 其他资产 | 21,254.70 | 0.15 |
| 9 | 合计 | 13,728,666.14 | 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港股通股票。

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 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 6,188,300.00 | 45.19 |
| 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 | 6,188,300.00 | 45.19 |

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 | 143735 | 18方正09 | 190,000 | 6,188,300.00 | 45.19 |

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 2022年2月19日，本基金管理人公布了《关于人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，自2022年2月19日起，本基金进入清算程序。截至本报告期末，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 21,254.70 |
| 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 | 21,254.70 |

5.11.4 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。

5.11.5 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股票投资。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 12,228,561.16 |
| 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 | 12,228,561.16 |

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§ 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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

| 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 | 20220401-20220630 | 12,208,000.00 | 0.00 | 0.00 | 12,208,000.00 | 99.83% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金出现了基金合同终止事由并发布了清算公告，最后运作日为2022年2月18日。本报告期，本基金处于清算期内。 | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据2021年7月5日北大方正集团有限公司公告,法院裁定批准北大方正集团有限公司等五家公司重整计划,并终止重整程序。2022年6月24日北大方正集团有限公司公告,北京一中院依法裁定批准延长重整计划执行期限至2022年12月28日,目前相关工作按照重整计划推进中。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》;
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
- 5、报告期内人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告的原稿。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

基金管理人办公地址:北京市西城区西长安街88号中国人保大厦

基金托管人地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话:400-820-7999

基金管理人网址: fund.piccamc.com

中国人保资产管理有限公司

2022年07月20日