

安信宝利债券型证券投资基金（LOF） 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信宝利（LOF）
场内简称	安信宝利
基金主代码	167501
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2013 年 7 月 24 日
报告期末基金份额总额	718,150,839.32 份
投资目标	在适度承担信用风险的情况下，力争实现基金财产当期稳定的超越基准的投资收益。
投资策略	本基金的债券投资主要将采用信用策略，同时辅以利率策略、收益率策略、回购策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、新股投资策略等积极投资策略，在适度控制风险的基础上，通过信用分析和对信用利差趋势的判断，为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险水平和预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工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（2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	3,583,509.13
2. 本期利润	5,180,856.25
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0082
4. 期末基金资产净值	742,783,605.40
5. 期末基金份额净值	1.034

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

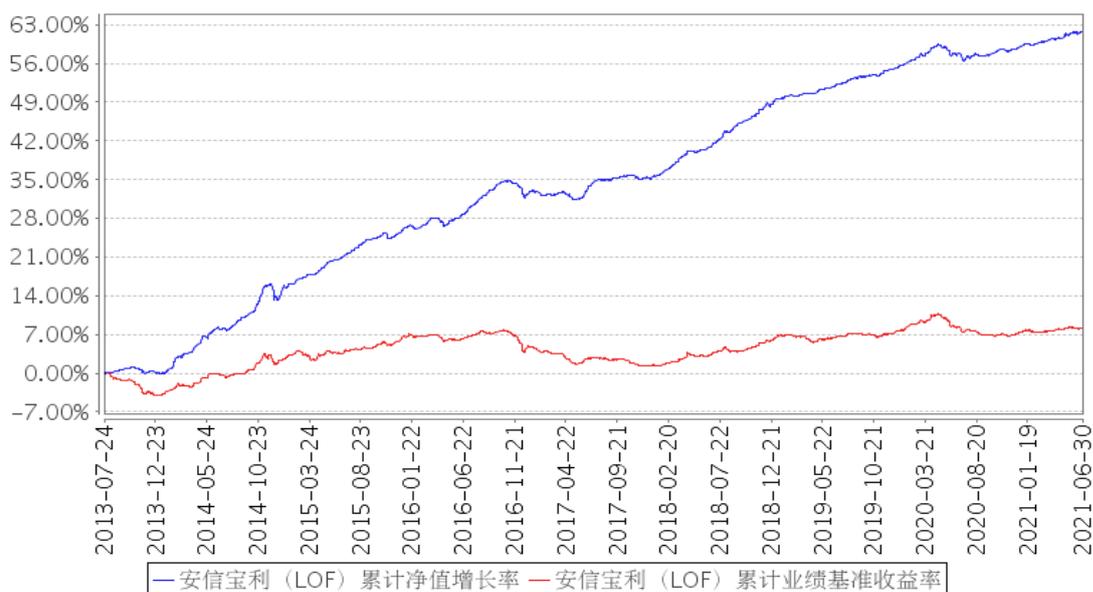
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.75%	0.07%	0.45%	0.03%	0.30%	0.04%
过去六个月	1.60%	0.06%	0.65%	0.04%	0.95%	0.02%
过去一年	2.47%	0.07%	-0.20%	0.06%	2.67%	0.01%
过去三年	14.36%	0.07%	4.53%	0.07%	9.83%	0.00%
过去五年	25.15%	0.07%	1.70%	0.07%	23.45%	0.00%
自基金合同 生效起至今	61.60%	0.09%	8.22%	0.08%	53.38%	0.01%

注：本基金自 2015 年 7 月 24 日转型以来，净值增长率为 32.66%。

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

安信宝利（LOF）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、本基金合同生效日为 2013 年 7 月 24 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		
庄园	本基金的基金经理	2013 年 7 月 24 日	-	17.0 年	庄园女士，经济学硕士。历任招商基金管理有限公司投资部交易员，工银瑞信基金管理有限公司投资部交易员、研究部研究员，中国国际金融有限公司资产管理部高级经理，安信证券股份有限公司证券投资部投资经理、资产管理部高级投资经理，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。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金的基金经理助理，安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信安盈保本混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信价值精选股票型证券投资基金的基金经理助

					理，安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信平稳合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

二季度初，由于地方债发行节奏放缓，流动性比较宽松，十年国债下行逾 10 个 bp，随后流

动性边际走紧，利率债收益率先上后下。信用债收益率二季度整体下行，低等级品种下行幅度更大，信用利差压缩至历史低位。

本基金二季度在控制仓位的前提下积极寻找转债的投资机会，降低了久期并调整了信用债的结构，改善了组合的流动性。

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 1.034 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.75%，同期业绩比较基准收益率为 0.45%。

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	709,240,082.39	90.72
	其中：债券	709,240,082.39	90.72
	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	30,000,215.00	3.84
	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	28,137,015.40	3.60
8	其他资产	14,427,003.29	1.85
9	合计	781,804,316.08	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。

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

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	159,129,900.00	21.42
	其中：政策性金融债	120,543,000.00	16.23
4	企业债券	188,530,122.00	25.38
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	232,117,000.00	31.25
7	可转债（可交换债）	32,293,060.39	4.35
8	同业存单	97,170,000.00	13.08
9	其他	-	-
10	合计	709,240,082.39	95.48

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	101801126	18 伊犁财通 MTN002	500,000	50,710,000.00	6.83
2	190207	19 国开 07	500,000	50,300,000.00	6.77
3	190202	19 国开 02	500,000	50,185,000.00	6.76
4	112109181	21 浦发银行 CD181	500,000	48,585,000.00	6.54
4	112118106	21 华夏银行 CD106	500,000	48,585,000.00	6.54
5	102001334	20 郟国投 MTN001	400,000	40,316,000.00	5.43

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 21 浦发银行 CD181（证券代码：112109181 CY）、21 华夏银行 CD106（证券代码：112118106 CY）、19 国开 07（证券代码：190207 CY）、19 国开 02（证券代码：190202 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。

2021 年 4 月 30 日，上海浦东发展银行股份有限公司因违规经营被上海银保监局罚款、责令改正【沪银保监罚决字（2021）29 号】。

2020 年 11 月 26 日，上海浦东发展银行股份有限公司因违规经营被国家外汇管理局上海市分局罚款、责令改正【上海汇管罚字（2020）20200007 号】。

2020 年 8 月 11 日，上海浦东发展银行股份有限公司因未依法履行职责，违规提供担保及财务资助，违规经营被上海银保监局罚款、责令改正【沪银保监银罚决字（2020）12 号】。

2021 年 5 月 21 日，华夏银行股份有限公司因违规经营被银保监会罚款 9830 万元【银保监罚决字（2021）19 号】。

2020 年，华夏银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被国家外汇管理局北京外汇管理部罚款

100万元、警告、没收违法所得；因违反了《合同违法行为监督处理办法》第十一条第一款第（四）项的规定被北京市东城区市场监督管理局行政处罚。【京汇罚（2020）27号、京汇罚（2020）28号、京东市监工罚(2020)133号】。

2020年12月25日，国家开发银行因未依法履行职责、信息披露虚假或严重误导性陈述被银保监会罚款4880万元【银保监罚决字（2020）67号】。

2020年，国家开发银行因涉嫌违反法律法规被国家外汇管理局北京外汇管理部罚款【京汇罚（2020）33号、京汇罚（2020）32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（元）
1	存出保证金	9,678.61
2	应收证券清算款	703,961.87
3	应收股利	-
4	应收利息	13,708,786.97
5	应收申购款	4,575.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,427,003.29

5.10.4 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	110045	海澜转债	5,877,319.50	0.79
2	113615	金诚转债	3,656,000.00	0.49
3	110053	苏银转债	3,640,800.00	0.49
4	113011	光大转债	3,467,400.00	0.47
5	110063	鹰19转债	2,359,800.00	0.32
6	110047	山鹰转债	2,333,400.00	0.31
7	113565	宏辉转债	2,149,600.00	0.29
8	113013	国君转债	1,128,100.00	0.15
9	128113	比音转债	900,860.80	0.12

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	662,471,457.91
报告期期间基金总申购份额	152,432,781.27
减：报告期期间基金总赎回份额	96,753,399.86
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	718,150,839.32

§ 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 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

无。

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、中国证监会核准安信宝利分级债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信宝利债券型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《安信宝利债券型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《安信宝利债券型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 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

2021 年 7 月 20 日