
富安达富利纯债债券型证券投资基金

2021 年第 2 季度报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2021 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.....	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	7
4.3 公平交易专项说明.....	8
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析.....	8
4.5 报告期内基金的业绩表现.....	8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	9
§5 投资组合报告.....	9
5.1 报告期末基金资产组合情况.....	9
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	9
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.....	10
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	10
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.....	10
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.....	10
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.....	10
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.....	11
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	11
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	11
5.11 投资组合报告附注.....	11
§6 开放式基金份额变动.....	11
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	12
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	12
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	12
§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	12
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.....	12
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	13
§9 备查文件目录.....	14
9.1 备查文件目录.....	14
9.2 存放地点.....	14
9.3 查阅方式.....	14

§ 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。基金托管人交通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	富安达富利纯债债券
基金主代码	007520
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年07月23日
报告期末基金份额总额	77,713,894.42份
投资目标	本基金在追求资产长期稳健增值的基础上，力争为份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益
投资策略	本基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采用自上而下的富安达多维经济模型，运用定性与定量分析方法，通过对全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合FED模型，判断和预测经济发展周期及趋势，构建和调整固定收益证券投资组合。 在进行固定收益类资产配置时，本基金首先通过久期配置、期限结构配置、类属配置策略来实现对固定收益类资产的配置。
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	本基金是债券型证券投资基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。
基金管理人	富安达基金管理有限公司

基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	富安达富利纯债债券A	富安达富利纯债债券C
下属分级基金的交易代码	007520	012603
报告期末下属分级基金的份额总额	77,709,218.50份	4,675.92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(2021年04月01日 - 2021年06月30日)	
	富安达富利纯债债券A	富安达富利纯债债券C
1. 本期已实现收益	494,698.78	6.61
2. 本期利润	905,773.89	9.13
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0637	0.0033
4. 期末基金资产净值	82,694,429.70	4,974.96
5. 期末基金份额净值	1.0642	1.0640

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

富安达富利纯债债券A净值表现

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	1.12%	0.02%	0.45%	0.03%	0.67%	-0.01%
过去六个月	2.05%	0.02%	0.65%	0.04%	1.40%	-0.02%

过去一年	3.52%	0.02%	-0.20%	0.06%	3.72%	-0.04%
自基金合同生效起至今	6.42%	0.04%	1.41%	0.07%	5.01%	-0.03%

富安达富利纯债债券C净值表现

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	0.24%	0.02%	0.10%	0.03%	0.14%	-0.01%

注：本基金自 2021 年 6 月 15 日起新增 C 类份额。

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

富安达富利纯债债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年07月23日-2021年06月30日)



富安达富利纯债债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年06月15日-2021年06月30日)



注：本基金自 2021 年 6 月 15 日起新增 C 类份额。

§ 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		
李飞	本基金的基金经理、多资产投资副总监(主持工作)兼固定收益部负责人	2019-07-23	-	5 年	历任银行间市场清算所股份有限公司产品开发部产品经理；光大证券股份有限公司风险管理部风控经理；恒丰银行股份有限公司资金营运中心债券自营交易员；国金证券上海证券资产管理分公司固定收益部投资经理。2018年10月加入富安达基金管理有限公司。2019年8月起任富

					安达富利纯债债券型证券投资基金的基金经理。
张凯瑜	本基金的基金经理	2019-07-23	-	5 年	历任银行间市场清算所股份有限公司产品开发部产品经理；光大证券股份有限公司风险管理部风控经理；恒丰银行股份有限公司资金营运中心债券自营交易员；国金证券上海证券资产管理分公司固定收益部投资经理。2018年10月加入富安达基金管理有限公司。2019年8月起任富安达富利纯债债券型证券投资基金的基金经理。
张帅	本基金的基金经理	2019-08-07	-	5 年	历任银行间市场清算所股份有限公司产品开发部产品经理；光大证券股份有限公司风险管理部风控经理；恒丰银行股份有限公司资金营运中心债券自营交易员；国金证券上海证券资产管理分公司固定收益部投资经理。2018年10月加入富安达基金管理有限公司。2019年8月起任富安达富利纯债债券型证券投资基金的基金经理。

注：

①基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，即基金的首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日，其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日；

②证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》及其各项实施准则、《富

安达富利纯债债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,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。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》,并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系,涵盖了所有投资组合,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公平对待旗下的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按照特定计算周期,分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异,未发现公平交易异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021年二季度,国内债券市场各期限收益率在国内增长边际趋缓、资金面持续宽松因素的推动下呈现陡峭化下行的走势,以国开债为例,一年期共下行25bp至2.51%,三年期下行20bp至2.85%,五年期下行11bp至3.25%,十年期共下行8bp至3.49%。4月资金面保持宽松,机构配置需求强且债券一级供给量少,市场呈现只交易利好不交易利空的多头局面,虽然大宗商品持续上涨,但债券市场并不担心眼前的工业通胀,直至4月下旬收益率企稳略有反弹,市场等待美联储会议及政治局会议的进一步信号。5月上旬,在基本面数据疲软与美国通胀数据高于预期的信息交织下收益率持续震荡,中旬大宗商品止涨下跌,债券市场出现一波下行,但月底前银行间流动性渐紧,机构对流动性前景有所担忧,导致收益率反弹。6月份,机构对流动性的担忧始终存在,叠加美国经济数据持续向好,美联储提高其对今年通胀及GDP增速的预期,其货币政策基调有趋鹰迹象,并上调超额准备金利率、隔夜逆回购利率5个BP以维护短期利率在目标区间内,内外因素交织带动收益率小幅上行直至6月下旬,央行通过金融时报向市场传递将维护流动性合理充裕的政策意图,显著安抚了机构对资金面不必要的担忧,带动收益率回落至月底。二季度收益率曲线陡峭化回落,各期限收益率水平整体接近或达到年初以来的最低位。

本基金二季度继续持有中短久期信用债与少量利率债。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达富利纯债债券A基金份额净值为1.0642元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.12%，同期业绩比较基准收益率为0.45%；截至报告期末富安达富利纯债债券C基金份额净值为1.0640元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.24%，同期业绩比较基准收益率为0.10%。

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	68,604,200.00	82.62
	其中：债券	68,604,200.00	82.62
	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	10,300,215.45	12.40
	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	2,081,271.05	2.51
8	其他资产	2,053,918.66	2.47
9	合计	83,039,605.16	100.00

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

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投资。

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投资的股票。

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投资。

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	10,060,000.00	12.16
	其中：政策性金融债	10,060,000.00	12.16
4	企业债券	58,544,200.00	70.79
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	68,604,200.00	82.96

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

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	190207	19国开07	100,000	10,060,000.00	12.16
2	1480405	14广元建设债	300,000	6,108,000.00	7.39
3	1480519	14张掖债	300,000	6,099,000.00	7.37
4	1480461	14渝九龙债	300,000	6,090,000.00	7.36
5	1480572	14来宾工投债	300,000	6,054,000.00	7.32

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投资。

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 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 本基金本报告期末未持有股票投资。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	450.38
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,039,684.55
5	应收申购款	13,783.73
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	2,053,918.66

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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	富安达富利纯债债券A	富安达富利纯债债券C
报告期期初基金份额总额	80,189,299.36	—
报告期期间基金总申购份额	3,112,218.02	4,675.92
减：报告期期间基金总赎回份额	5,592,298.88	—
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	77,709,218.50	4,675.92

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 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

	富安达富利纯债债券A	富安达富利纯债债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	34,572,750.66	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	34,572,750.66	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	44.49	0.00

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 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	20210401-20210630	34,572,750.66	0.00	0.00	34,572,750.66	44.49%
	2	20210401-20210630	39,311,876.24	0.00	0.00	39,311,876.24	50.59%

产品特有风险

当持有基金份额比例达到或超过20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。

注：

- ① “申购份额”包含份额申购、转换转入、红利再投等导致份额增加的情况；
- ② “赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致份额减少的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1. 2021年4月8日，富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告
2. 2021年4月21日，富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告
3. 2021年4月21日，富安达富利纯债债券型证券投资基金2021 年第1 季度报告
4. 2021年4月26日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加财咨道信息技术有限公司为销售机构并与其费率优惠活动的公告
5. 2021年4月28日，富安达基金管理有限公司关于参加部分基金销售机构费率优惠活动的公告
6. 2021年5月7日，富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告
7. 2021年5月18日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加泛华普益为销售机构的公告
8. 2021年5月26日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加万得基金为销售机构的公告
9. 2021年6月4日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加大连网金基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告
10. 2021年6月7日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京钱景基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告
11. 2021年6月7日，富安达基金管理有限公司关于参加上海万得基金销售有限公司费率优惠活动的公告
12. 2021年6月15日，富安达富利纯债债券型证券投资基金基金合同
13. 2021年6月15日，富安达富利纯债债券型证券投资基金托管协议
14. 2021年6月15日，富安达基金管理有限公司关于富安达富利纯债债券型证券投资基金增设 C 类基金份额及增加侧袋机制并修订基金合同和托管协议的公告
15. 2021年6月16日，富安达富利纯债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新
16. 2021年6月16日，富安达富利纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）（二零二一年第一号）
17. 2021年6月16日，富安达富利纯债债券型证券投资基金招募说明书更新提示性公告
18. 2021年6月16日，富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告
19. 2021年6月18日，富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告

20. 2021年6月25日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海爱建基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富安达富利纯债债券型证券投资基金设立的文件：
《富安达富利纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
《富安达富利纯债债券型证券投资基金基金合同》；
《富安达富利纯债债券型证券投资基金托管协议》。
- 2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 3、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 4、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.fadfunds.com）查阅。

富安达基金管理有限公司

2021年07月20日