

方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

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 7 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 4 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	方正富邦睿利纯债	
交易代码	003795	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 16 日	
报告期末基金份额总额	400,080,786.91 份	
投资目标	在控制投资风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	<p>本基金在有效风险管理的基础上，通过自上而下的宏观研究和自下而上的证券研究，充分使用积极投资、数量投资、无风险套利等有效投资手段，努力为投资者提供好的回报。</p> <p>本基金投资组合中债券、现金各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金，其资产配置以债券为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、市场利率、债券供求、申购赎回现金流情况等因素，在一定的范围内对资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。</p>	
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	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险的产品。	
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	方正富邦睿利纯债 A	方正富邦睿利纯债 C

下属分级基金的交易代码	003795	003796
报告期末下属分级基金的份额总额	400,029,243.93 份	51,542.98 份

方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金于 2016 年 12 月 16 日成立，后经《关于准予方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可【2021】1283 号）变更注册，并于 2021 年 5 月 27 日召开基金份额持有人大会表决通过了《关于方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金更换基金托管人有关事项的议案》，修订后的《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金基金合同》自 2021 年 5 月 28 日起生效。

§ 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）	
	方正富邦睿利纯债 A	方正富邦睿利纯债 C
1. 本期已实现收益	2,014,985.16	196.05
2. 本期利润	4,760,500.16	551.37
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0119	0.0117
4. 期末基金资产净值	422,351,050.03	54,103.55
5. 期末基金份额净值	1.0558	1.0497

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、修订后的《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金基金合同》生效日为 2021 年 5 月 28 日，本报告中的财务指标、图表、净值表现、投资组合报告等内容，不受该合同生效日变更影响，仍保持历史数据的延续性，以 2016 年 12 月 16 日（初始成立日）为起始日进行编制。

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

方正富邦睿利纯债 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	1.14%	0.03%	0.45%	0.03%	0.69%	0.00%
过去六个月	1.79%	0.04%	0.65%	0.04%	1.14%	0.00%
过去一年	2.02%	0.07%	-0.20%	0.06%	2.22%	0.01%

过去三年	11.16%	0.09%	4.53%	0.07%	6.63%	0.02%
自基金合同生效起至今	19.61%	0.08%	3.95%	0.07%	15.66%	0.01%

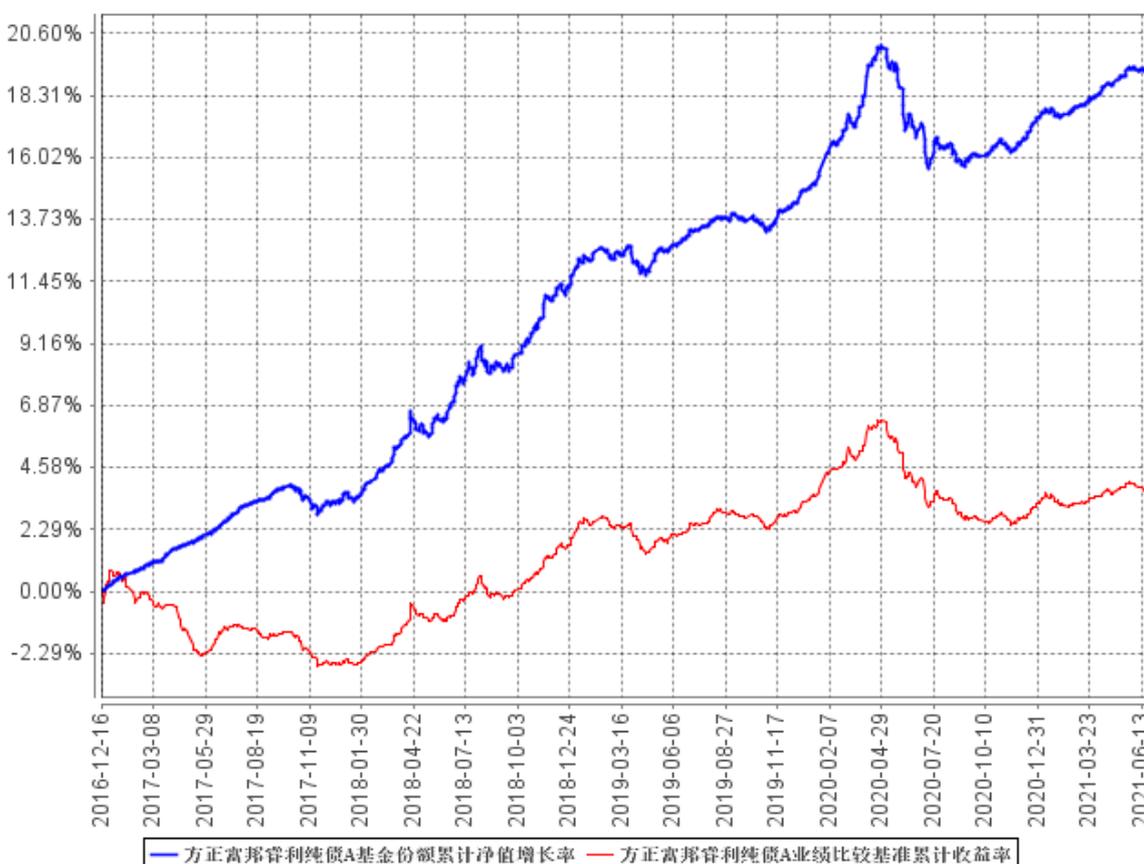
方正富邦睿利纯债 C

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	1.09%	0.03%	0.45%	0.03%	0.64%	0.00%
过去六个月	1.71%	0.03%	0.65%	0.04%	1.06%	-0.01%
过去一年	1.83%	0.07%	-0.20%	0.06%	2.03%	0.01%
过去三年	10.66%	0.09%	4.53%	0.07%	6.13%	0.02%
自基金合同生效起至今	19.05%	0.08%	3.95%	0.07%	15.10%	0.01%

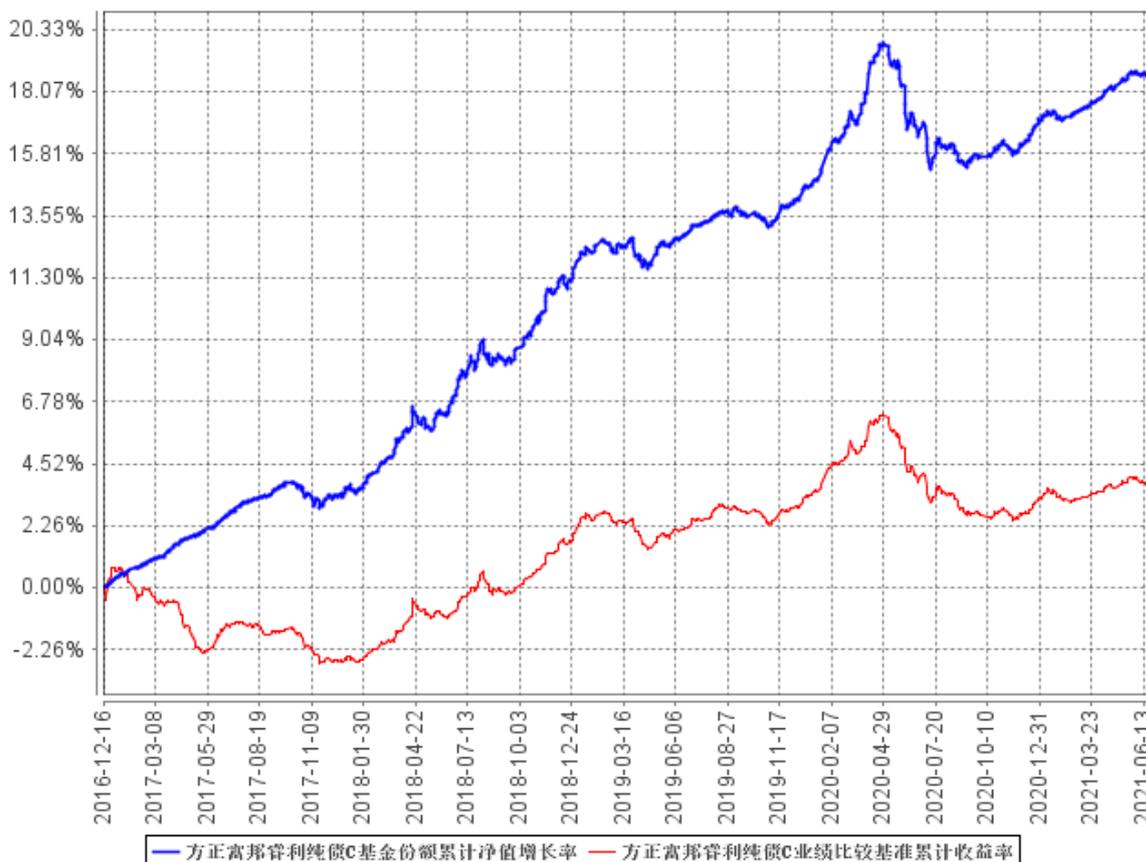
注：为保持历史数据的延续性，本部分所涉自基金合同生效以来相关数据的计算以 2016 年 12 月 16 日（初始成立日）为起始日进行编制。

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

方正富邦睿利纯债A基金份额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



方正富邦睿利纯债C基金份额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：为保持历史数据的延续性，本部分所涉自基金合同生效以来相关数据的计算以 2016 年 12 月 16 日（初始成立日）为起始日进行编制。

§ 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		
区德成	固定收益基金投资部总经理兼本基金基金经理	2021 年 1 月 19 日	-	9 年	理学硕士，注册金融分析师（CFA），曾任宁波银行股份有限公司总行金融市场部交易员；2013 年 5 月加入晋城银行股份有限公司，历任金融市场总部债券交易主管，投资交易部副总经理，固定收益部总经理；2020 年 7 月至报告期末任方正富邦

				基金有限公司固定收益基金投资部总经理、执行董事、投资决策委员会委员。2021 年 1 月至报告期末,任方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金、方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金、方正富邦富利纯债债券型发起式证券投资基金、方正富邦恒利纯债债券型证券投资基金、方正富邦丰利债券型证券投资基金基金经理。	
程同朦	本基金经理	2019 年 6 月 24 日	-	11 年	<p>本科毕业于山东师范大学教育技术学专业,硕士毕业于同济大学金融学专业。2010 年 5 月至 2011 年 1 月于爱建证券有限责任公司担任债券交易员;2011 年 2 月至 2012 年 3 月于东兴证券股份有限公司担任债券交易员;2012 年 3 月至 2014 年 4 月于包商银行股份有限公司担任债券投资经理;2014 年 7 月至 2017 年 4 月于中国邮政储蓄银行股份有限公司上海分行担任同业投资经理;2017 年 4 月至 2019 年 1 月于财通证券股份有限公司担任投资顾问部经理;2019 年 1 月至 2019 年 3 月于方正富邦基金管理有限公司固定收益基金投资部担任拟任基金经理;2019 年 3 月至报告期末,任方正富邦金小宝货币市场证券投资基金、方正富邦货币市场基金、方正富邦富利纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理;2019 年 6 月至报告期末,任方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金、方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金、方正富邦丰利债券型证券投资</p>

					基金基金经理。2020 年 6 月至报告期末，任方正富邦恒利纯债债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1. “任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定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。

3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

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

本报告期内无此情况。

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相关法律法规及基金合同的规定，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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，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

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《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定，通过系统和人工等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。

在投资决策内部控制方面，本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库，确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度，通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式，使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面，本基金管理人实行集中交易制度，交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先，价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易，按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度，报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2021 年第二季度，债券市场呈现震荡上涨的格局，收益率缓慢下行。其中，4 月份和 5 月份受到资金面稳定和经济同比增长越过最高峰的影响债券市场以上涨为主；6 月份资金面边际

波动加大，债券收益率先上后下，市场整体保持区间震荡。

报告期内，针对当前债市的整体特点，一方面保持必要的静态收益率和杠杆水平获得稳定的票息和息差收入，另一方面动态调整久期水平力求在控制回撤的基础上获得一定的资本利得收入增厚产品收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末方正富邦睿利纯债 A 基金份额净值为 1.0558 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.14%；截至本报告期末方正富邦睿利纯债 C 基金份额净值为 1.0497 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.09%；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

本基金报告期内，曾于 2021 年 4 月 1 日至 2021 年 5 月 10 日出现超过连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情况，未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情况。

§ 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	502,268,000.00	90.70
	其中：债券	502,268,000.00	90.70
	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	42,288,539.22	7.64
8	其他资产	9,191,923.70	1.66
9	合计	553,748,462.92	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股票投资。

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投资。

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全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资。

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	100,239,000.00	23.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	402,029,000.00	95.18
	其中：政策性金融债	160,645,000.00	38.03
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	502,268,000.00	118.91

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	200212	20 国开 12	500,000	50,250,000.00	11.90
2	2128012	21 浦发银行 01	400,000	40,352,000.00	9.55
3	1820077	18 温州银行	400,000	40,268,000.00	9.53
4	200013	20 付息国债 13	400,000	40,164,000.00	9.51
5	200207	20 国开 07	400,000	40,112,000.00	9.50

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。

5.10 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受到调查以及处罚的情况的说明

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。

5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.10.3 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	9,191,923.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	9,191,923.70

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

项目	方正富邦睿利纯债 A	方正富邦睿利纯债 C
报告期期初基金份额总额	400,028,322.81	3,709.53
报告期期间基金总申购份额	2,477.47	48,319.98
减:报告期期间基金总赎回份额	1,556.35	486.53
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	400,029,243.93	51,542.98

注：总申购份额含转换入份额，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

本报告期本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

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	400,000,000.00	-	-	400,000,000.00	99.98%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，可能会引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。在极端情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日持续低于五千万元，基金可能面临转换运作方式、与其</p>							

他基金合并或者终止基金合同等情形。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金经中国证监会《关于准予方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2280 号文）准予注册。基金管理人为方正富邦基金管理有限公司，基金托管人为包商银行股份有限公司，基金合同生效日为 2016 年 12 月 16 日。

2021 年 2 月 7 日由中国证监会指定中国建设银行股份有限公司为本基金临时基金托管人。

2021 年 4 月 27 日至 2021 年 5 月 26 日方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金更换基金托管人并修改基金合同有关事项的议案》，方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自 2021 年 5 月 28 日起，原《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金基金合同》失效，更换基金托管人后的《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金基金合同》生效。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (2) 《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

方正富邦基金管理有限公司

2021 年 7 月 21 日