

信澳安盛纯债债券型证券投资基金
2022 年第 2 季度报告
2022 年 6 月 30 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年七月二十日

§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。

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	信澳安盛纯债
基金主代码	007768
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 26 日
报告期末基金份额总额	89,913,699.74 份
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳定的基础上，通过积极主动的管理，力争实现基金资产净值的持续、稳健增长。
投资策略	本基金将采取自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的投资策略，通过对宏观经济、国家政策、信用主体评级水平等各种影响债券投资的因素细致深入的分析，确定债券组合资产在国债、金融债、信用债等品种之间的类属配置比例。在此基础上，综合运用久期策略、收益率曲线策略、回购套利策略和个券选择策略积极主动地进行资产投资组合的构建。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司
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 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	450,593.85
2.本期利润	515,566.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.0084
4.期末基金资产净值	92,709,095.70
5.期末基金份额净值	1.0311

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），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

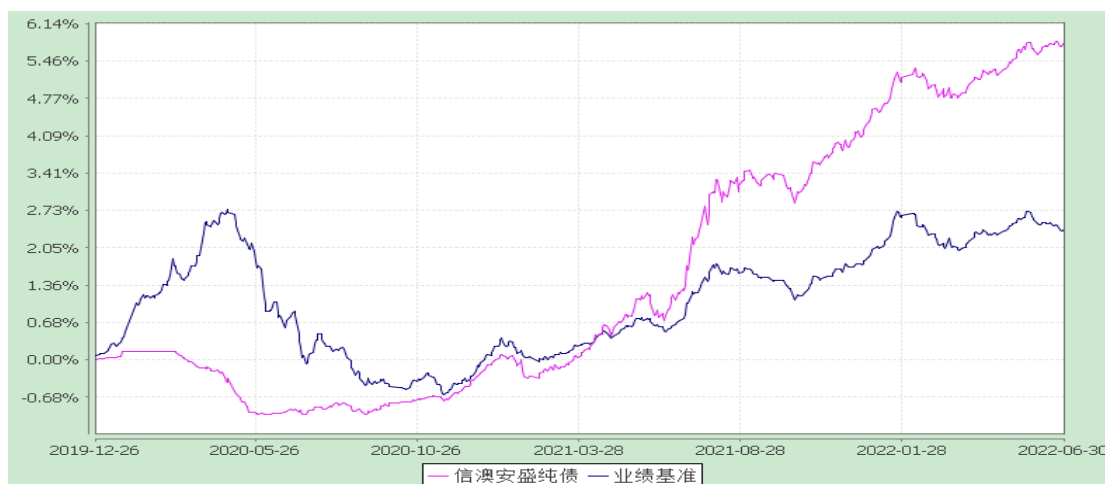
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.80%	0.05%	0.27%	0.03%	0.53%	0.02%
过去六个月	1.18%	0.06%	0.36%	0.05%	0.82%	0.01%
过去一年	4.52%	0.08%	1.68%	0.05%	2.84%	0.03%
自基金合同生效起至今	5.80%	0.06%	2.39%	0.06%	3.41%	0.00%

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

信澳安盛纯债债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 12 月 26 日至 2022 年 6 月 30 日)



§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		
张旻	本基金的基金经理	2021-12-20	-	11.5 年	复旦大学学士、剑桥大学硕士。2010年7月至2016年6月先后于交通银行资产管理业务中心任高级投资经理、于交银国际控股有限公司任董事总经理,2016年6月至2020年12月先后于中信银行资产管理业务中心任副处长、于信银理财有限公司任部门副总经理。2020年12月加入信达澳亚基金管理有限公司,现任混合资产投资部总监,信澳信用债债券基金基金经理(2021年6月8日起至今)、信澳安盛纯债基金基金经理(2021年12月20日起至今)、信澳优享债券基金基金经理(2021年12月23日起至今)。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

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《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，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，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。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成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的 5% 的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来，市场流动性充裕，主要政策目标为推动宽信用政策落地。利率债和信用债短端收益率上半年先下后上，随着社融触底反弹、地产放松信号边际升级及部分资管产品赎回卖出，6 月利率全线回调。下半年，债市面临“混乱的预期”，或在较长时间内处于震荡区间，其中最为重要的变量是地产投资与社融的变化。一方面是房企销售有所恢复，但房价没有上升，一方面是下调首付比例及贷款利率为代表的多地地产调控政策放松超预期，市场多空分歧较大的格局并未变化。上半年由于疫情反复，经济增长不及预期，为完成本年 GDP 增速 5.5% 的目标，6 月中旬的国常会要求：“抓住时间窗口，注重区间调控，既果断加大力度、稳经济政策应出

尽出，又不超发货币、不透支未来，着力保市场主体保就业稳物价，稳住宏观经济大盘。”6月27日，易纲在专访中明确表示：“货币政策将继续从总量上发力以支持经济复苏。”在总量政策刺激下，贷款增速连续二个月加速，结构上居民的按揭贷款依然疲软，企业的中长期贷款却开始加速，居民需求不足是信贷及经济复苏的制约因素，社融同比增速企稳已经在5、6月数据得到验证，但地产销售企稳、房企拿地和建设意愿回升尚未看到，地产投资增速回正向上货币政策才能有退出的空间。时间差及预期差均会对债券市场造成较大变数，目前长端利率已经回调至2021年下半年首次降准后的水平充分反映了未来稳增长预期，已经进入具有配置价值的区间。2022下半年，债券或出现区间震荡的走势，本基金在做好流动性管理的前提下，紧密跟踪市场变化，积极参与利率债交易，以获取波段投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.0311元，份额累计净值为1.0574元，本报告期内，本基金份额净值增长率为0.80%，同期业绩比较基准收益率为0.27%。

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	81,027,847.14	72.09
	其中：债券	81,027,847.14	72.09
	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	1,000,000.00	0.89
	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	1,309,312.41	1.16
8	其他资产	29,066,850.54	25.86
9	合计	112,404,010.09	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境内股票。

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	3,625,996.93	3.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	72,623,613.50	78.33
	其中：政策性金融债	72,623,613.50	78.33
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	4,778,236.71	5.15
10	合计	81,027,847.14	87.40

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	190208	19 国开 08	200,000	21,072,126.03	22.73
2	210207	21 国开 07	200,000	20,247,013.70	21.84
3	018008	国开 1802	140,600	14,839,108.90	16.01
4	018016	国开 19G1	80,000	8,193,238.36	8.84
5	018009	国开 1803	60,230	7,190,267.30	7.76

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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。

无。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

无。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	20,774.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,046,075.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,066,850.54

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

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况

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	61,065,203.16
报告期期间基金总申购份额	29,672,715.91
减：报告期期间基金总赎回份额	824,219.33
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	89,913,699.74

§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

基金管理人本报告期末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

基金管理人报告期末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	2022 年 04 月 01 日 - 2022 年 06 月 30 日	60,592,809.53	-	-	60,592,809.53	67.39%
个人	1	2022 年 06 月 30 日 - 2022 年 06 月 30 日	-	28,137,977.88	-	28,137,977.88	31.29%
产品特有风险							
1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险； 2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动； 3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算； 4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。							

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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳安盛纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳安盛纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 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；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

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/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二二年七月二十日