

# 安信宝利债券型证券投资基金（LOF） 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 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：2022 年 10 月 25 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 2022 年 10 月 24 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 安信宝利（LOF）   |
| 场内简称       | 安信宝利债券 LOF  |
| 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 | 50,227,813.55 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 233,842.25                          |
| 2. 本期利润         | 157,620.52                          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0037                              |
| 4. 期末基金资产净值     | 52,146,939.60                       |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.038                               |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

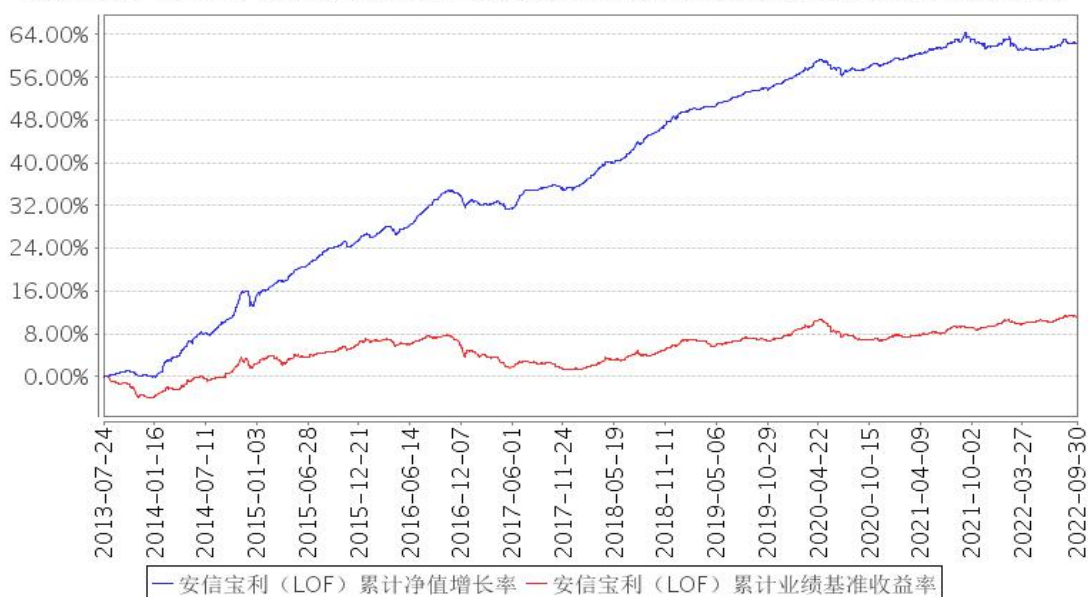
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 0.39%      | 0.07%         | 0.73%          | 0.05%                 | -0.34% | 0.02% |
| 过去六个月          | 0.68%      | 0.07%         | 1.03%          | 0.04%                 | -0.35% | 0.03% |
| 过去一年           | -0.48%     | 0.09%         | 1.73%          | 0.05%                 | -2.21% | 0.04% |
| 过去三年           | 5.60%      | 0.08%         | 3.81%          | 0.07%                 | 1.79%  | 0.01% |
| 过去五年           | 19.76%     | 0.07%         | 8.27%          | 0.06%                 | 11.49% | 0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 62.23%     | 0.09%         | 11.01%         | 0.08%                 | 51.22% | 0.01% |

注：本基金自 2015 年 7 月 24 日转型以来，净值增长率为 33.17%。

#### 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 |        |  |
| 宛晴 | 本基金的基金经理 | 2022 年 6 月 23 日 | -    | 9 年    | 宛晴女士，工商管理硕士，历任东兴证券股份有限公司资产管理业务总部交易员、交易主管、投资经理助理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。现任安信现金增利货币市场基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）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遵规守信情况的说明

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会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

2022 年三季度国内经济再度转弱，之后在政策发力下有所修复。整体来看三季度内外需均承压，内需受地产断供风波、国内疫情反复、局地自然灾害及限电等因素的影响边际减弱，外需在海外货币政策收紧影响下呈现回落态势。出口在外需带动下对经济的拉动逐步减弱，消费受疫情制约恢复较慢，投资方面呈现基建投资持续走强、制造业投资保持韧性、地产投资延续下滑的态势。伴随稳增长相关政策的加速出台和落地，国内生产有所修复，PMI 在 9 月重回荣枯线上方。通胀方面，目前仍处于相对温和水平，受上游原材料价格回落、内需转弱影响，CPI 和 PPI 的剪刀差由负转正，中下游企业利润继续得以改善。海外方面，美联储延续鹰派加息，在中美经济周期和政策周期全面错位的背景下，中美利差倒挂幅度不断扩大，人民币汇率贬值幅度超预期。伴随市场关注点从国内经济基本面承压转向人民币汇率承压，三季度债券市场收益率呈现“V”型走势。权益市场三季度呈现震荡下行走势，除煤炭外的行业均下跌，建筑材料、电力设备、电子、汽车等板块跌幅居前。转债市场三季度呈现先涨后跌走势，前期在流动性宽松、债券收益率下行的背景下韧性较强，受新规影响成交持续收缩，8 月中旬后在权益市场和债券市场的双重压力下持续回调，转股溢价率整体大幅走阔，债性转债和低价品种回调幅度显著小于指数。

本基金操作方面，7 月增加了可转债的投资比例，8、9 月逐步减持了全部可转债，增加了利

率债的持仓比例和债券组合久期。

#### 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 1.038 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.39%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2022 年 7 月 1 日至 2022 年 8 月 8 日。

### § 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            | 43,559,322.18 | 79.50        |
|    | 其中：债券             | 43,559,322.18 | 79.50        |
|    | 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          | 8,000,989.21  | 14.60        |
|    | 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      | 3,228,047.87  | 5.89         |
| 8  | 其他资产              | 4,419.25      | 0.01         |
| 9  | 合计                | 54,792,778.51 | 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。

#### 5.4 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      | 10,028,575.34 | 19.23        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 33,530,746.84 | 64.30        |
|    | 其中：政策性金融债 | 32,284,881.46 | 61.91        |
| 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        | 43,559,322.18 | 83.53        |

#### 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  | 220206 | 22 国开 06 | 200,000 | 20,125,358.90 | 38.59        |
| 2  | 200202 | 20 国开 02 | 100,000 | 10,086,178.08 | 19.34        |
| 3  | 019681 | 22 国债 16 | 100,000 | 10,028,575.34 | 19.23        |
| 4  | 018010 | 国开 1902  | 20,000  | 2,052,912.33  | 3.94         |
| 5  | 155804 | 19 华创 04 | 12,000  | 1,245,865.38  | 2.39         |

#### 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 22 国开 06（代码：220206 CY）、20 国开 02（代码：200202 CY）、国开 1902（代码：018010 SH）、农发 2101（代码：108903 SZ）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。

#### 1. 国家开发银行

2022年3月25日，国家开发银行因未依法履行职责被中国银行保险监督管理委员会处以罚款。

#### 2. 中国农业发展银行

2022年3月25日，中国农业发展银行因违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 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   | 2,081.24 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | -        |
| 5  | 应收申购款   | 2,338.01 |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 其他      | -        |
| 8  | 合计      | 4,419.25 |

### 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               | 40,277,705.97 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 23,896,578.80 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 13,946,471.22 |
| 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               | 50,227,813.55 |

## § 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

2022 年 10 月 25 日