

## 申万菱信泰惠利纯债债券型证券投资基金

## 2019年第二季度报告

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一九年七月十六日

§ 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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2019年7月12日核了本报表中的财务指标、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。

基金过往的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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年3月30日止。

§ 2. 基金产品概况

基金简称 申万菱信泰惠利纯债债券

基金代码 000906

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2016年8月16日

报告期末基金资产净值 209,362,073.98元

报告期末基金份额总额 10,889,925.00份

基金类型 债券型基金

基金管理人 申万菱信基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 安泰利纯债A 安泰利纯债C

下属分级基金的交易代码 000906 000909

报告期末下属分级基金的份额总额 108,476,190.49份 10,889,925.00份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)

安泰利纯债A 安泰利纯债C

1.本期已实现收益 1,075,109.38 91,930.00

2.本期利润 1,090,065.60 10,313.73

3.期末可供分配基金份额利润 0.0089 0.0008

4.期末基金资产净值 208,946,025.03 11,456,201.05

5.期末基金份额净值 1.0528 1.0523

注:1)本基金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，本期利润为其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，期末可供分配基金份额利润为本基金已实现收益加上本期利润。

2)上述基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如：申购费、赎回费等)，计入认购或交易基金份额后的费用后，实际收益水平将低于上述数字。

3.2.基金净值表现

3.2.1.本基金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

1.安泰利纯债A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 收益率差(%) 收益率差标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 0.07% 0.01% -0.07% 0.00% 1.25% -0.05%

2.安泰利纯债C

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 收益率差(%) 收益率差标准差(%) ①-③ ②-④

过去一个月 0.07% 0.01% -0.07% 0.00% 1.25% -0.05%

3.2.2.本基金报告期内以期末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

申万菱信泰惠利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图(2018年8月16日至2019年6月30日)

1. 安泰利纯债A:

注:1)自基金合同生效以来，本基金运作未满一年。

2)本基金已在建仓期结束时，使基金的投资组合比例符合基金合同的有关定。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金基金经理的日期 离任日期 说明

叶琳琳 本基金基金经理 2018-08-16 - 14年

叶琳琳女士，硕士研究生，2006年1月加入申万菱信基金管理有限公司，历任基金客户服务部、销售部分析师，基金经理助理，申万菱信货币基金基金经理，申万菱信泰利纯债债券型基金基金经理，申万菱信泰利纯债债券型基金基金经理，申万菱信泰利纯债债券型基金基金经理。

注:1)任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理对基金合同生效日起任职，则任职日期为基金合同生效日。

2)证券从业的含义遵从行业协会《证券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遵规守信情况的说明

本公司报告期内，基金管理人严格按照《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋取利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，信息披露及时、准确、完整；基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，多项风险指标两度小幅回撤，长期下行压力再现，中美贸易摩擦再掀波澜，对市场偏好产生明显抑制，通胀水平维持高位，但中枢有所上升。货币政策紧后松，市场流动性较为宽松，资金成本维持低位。

今年二季度债券收益率呈现出震荡走势。全季度来看，10年期政策性金融债收益率先小幅上行，此后震荡回落，季末较季初下行的5BP到10BP，信用债呈现先抑后扬走势，整体表现较为平淡。低等级信用债风险暴露依然较多，利差有所扩大。

报告期内，本公司基金管理人严格按照《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋取利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，信息披露及时、准确、完整；基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，多项风险指标两度小幅回撤，长期下行压力再现，中美贸易摩擦再掀波澜，对市场偏好产生明显抑制，通胀水平维持高位，但中枢有所上升。货币政策紧后松，市场流动性较为宽松，资金成本维持低位。

今年二季度债券收益率呈现出震荡走势。全季度来看，10年期政策性金融债收益率先小幅上行，此后震荡回落，季末较季初下行的5BP到10BP，信用债呈现先抑后扬走势，整体表现较为平淡。低等级信用债风险暴露依然较多，利差有所扩大。