

融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金

2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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 2020 年 10 月 26 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 2020 年 7 月 1 日起至 2020 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	融通通裕定开债券发起式
基金主代码	002869
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 14 日
报告期末基金份额总额	1,951,960,356.78 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金的具体投资策略包括资产配置策略、利率策略、信用策略、类属配置与个券选择策略以及资产支持证券投资策略等部分。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
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,属于较低风险/收益的产品。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

注：本基金由融通通裕债券型证券投资基金转型而来，转型前的基金合同生效日为 2016 年 11 月 2 日。

## § 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（2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	28,291,460.18
2. 本期利润	20,018,035.33

3. 加权平均基金份额本期利润	0.0103
4. 期末基金资产净值	2,023,248,150.79
5. 期末基金份额净值	1.0365

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、本报告所列示的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。

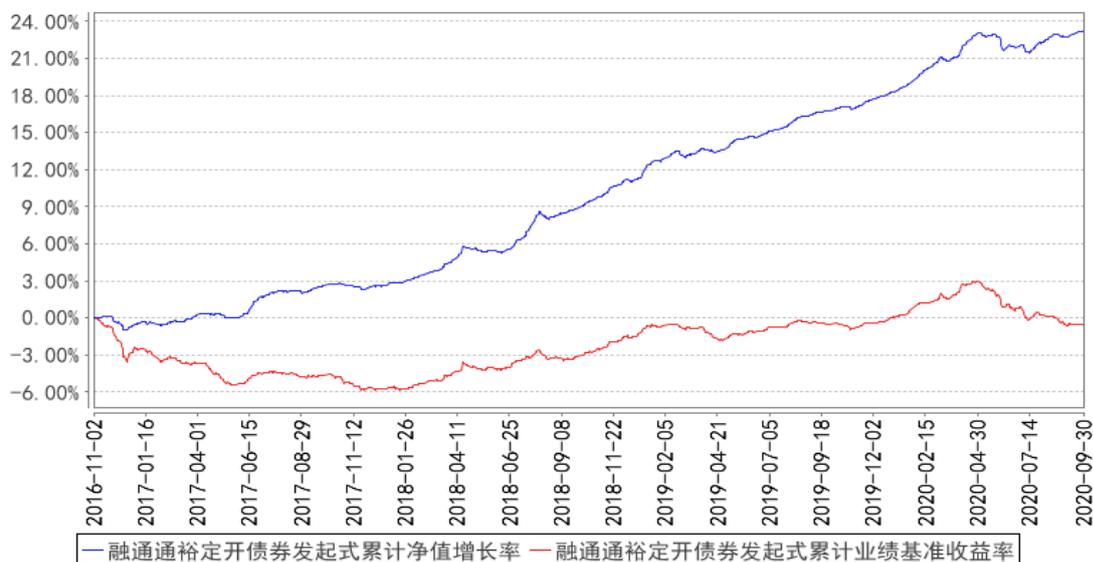
### 3.2 基金净值表现

#### 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	1.03%	0.05%	-1.48%	0.08%	2.51%	-0.03%
过去六个月	1.73%	0.07%	-2.50%	0.10%	4.23%	-0.03%
过去一年	5.51%	0.06%	-0.09%	0.09%	5.60%	-0.03%
过去三年	20.10%	0.06%	4.21%	0.07%	15.89%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	23.22%	0.06%	-0.61%	0.08%	23.83%	-0.02%

#### 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

融通通裕定开债券发起式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：本基金由“融通通裕债券型证券投资基金”转型而来，转型前的基金合同生效日为 2016 年 11 月 2 日，转型后基金合同生效日为 2018 年 3 月 14 日，因本基金转型前后投资目标、投资范围策略及业绩比较基准均与转型前“融通通裕债券型证券投资基金”相同，上图业绩指标计算不分转型前后。

## § 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		
张一格	本基金的基金经理、固定收益投资总监	2018 年 3 月 14 日	-	14 年	张一格先生，中国人民银行研究生部经济学硕士，特许金融分析师（CFA），14 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2006 年 6 月至 2012 年 8 月就职于兴业银行资金营运中心任投资经理，2012 年 8 月至 2015 年 6 月就职于国泰基金管理有限公司任国泰民安增利债券等基金的基金经理。2015 年 6 月加入融通基金管理有限公司，历任固定收益部总经理、融通易支付货币市场证券投资基金基金经理、融通通盈保本混合型证券投资基金基金经理、融通增裕债券型证券投资基金基金经理、融通增祥债券型证券投资基金基金经理、融通增丰债券型证券投资基金基金经理、融通通瑞债券型证券投资基金基金经理、融通通优债券型证券投资基金基金经理、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通通景灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通昊定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，现任公司固定收益投资总监、融通收益增强债券型证券投资基金基金经理、融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通通源短融债券型证券投资基金基金经理、融通通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通昊三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券、基金业务相关工作的时间为计算标准。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，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，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，并制定了相应的制度和流程，在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年三季度，货币政策的边际变化进一步被确认，市场的资金利率不断抬升，债券市场持续处于调整状态。尽管期间还有摊余成本法基金的建仓和海外配债资金的流入，但给债券市场带来的暖意有限。

本基金在控制好久期的同时，选择绝对收益较高的信用债进行配置，并做好资产的轮换工作，努力提升组合整体收益。

## 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 1.0365 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.03%，业绩比较基准收益率为-1.48%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

## § 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	2,689,991,900.00	97.25
	其中：债券	2,689,991,900.00	97.25
	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	11,940,211.85	0.43
8	其他资产	64,030,546.50	2.31
9	合计	2,765,962,658.35	100.00

## 5.2 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	750,439,800.00	37.09
5	企业短期融资券	410,012,200.00	20.27
6	中期票据	1,529,539,900.00	75.60
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,689,991,900.00	132.95

## 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	101800186	18 鸿商产业 MTN001	1,000,000	100,670,000.00	4.98
2	102000109	20 农垦 MTN001	1,000,000	100,380,000.00	4.96
3	149120	20 湘建 01	1,000,000	97,540,000.00	4.82
4	041900437	19 西部矿业 CP001	900,000	90,648,000.00	4.48
5	101900665	19 本钢集团 MTN002	900,000	90,054,000.00	4.45

## 5.4 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

无。

## 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贵金属投资明细

无。

**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五名权证投资明细**

无。

**5.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****5.7.1 本期国债期货投资政策**

无。

**5.7.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无。

**5.7.3 本期国债期货投资评价**

无。

**5.8 投资组合报告附注**

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有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。

**5.8.2 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	15,001.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	64,015,544.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,030,546.50

**5.8.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,943,567,179.75
报告期期间基金总申购份额	8,393,187.01
减：报告期期间基金总赎回份额	9.98
报告期期末基金份额总额	1,951,960,356.78

## § 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

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,173,661.54
报告期期间买入/申购总份额	1,187,451.26
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,361,112.80
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.58

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	红利再投	2020年07月16日	1,079,549.97	1,115,606.94	-
2	红利再投	2020年09月24日	107,901.29	111,753.37	-
合计			1,187,451.26	1,227,360.31	

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	11,361,112.80	0.58	9,633,911.37	0.49	不低于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,361,112.80	0.58	9,633,911.37	0.49	-

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

## 9.1 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	20200701-20200930	1,933,370,853.91	-	-	1,933,370,853.91	99.05
个人	-	-	-	-	-	-	-

人						
产品特有风险						
当基金份额持有人占比过于集中时，可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。						

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会《关于准予融通通裕债券型证券投资基金变更注册的批复》
- (二) 《关于融通通裕债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》
- (三) 《融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- (四) 《融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- (五) 《融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- (六) 中国证监会批准融通通裕债券型证券投资基金设立的文件
- (七) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (八) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查询。

融通基金管理有限公司

2020 年 10 月 27 日