

# 融通通昊三个月定期开放债券型发起式 证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 22 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	融通通昊三个月定期开放债券型发起式
基金主代码	005289
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 11 日
报告期末基金份额总额	1,479,954,923.76 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	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。封闭期内，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，适时调整组合久期，以获得基金资产的稳定增值，提高基金总体收益率；开放期内，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。
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，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

注：本基金由融通通昊定期开放债券型发起式证券投资基金转型而来，转型前的基金合同生效日为 2018 年 4 月 17 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（2021年7月1日-2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	15,497,273.11
2. 本期利润	19,314,506.84
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0131
4. 期末基金资产净值	1,501,109,495.93
5. 期末基金份额净值	1.0143

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。

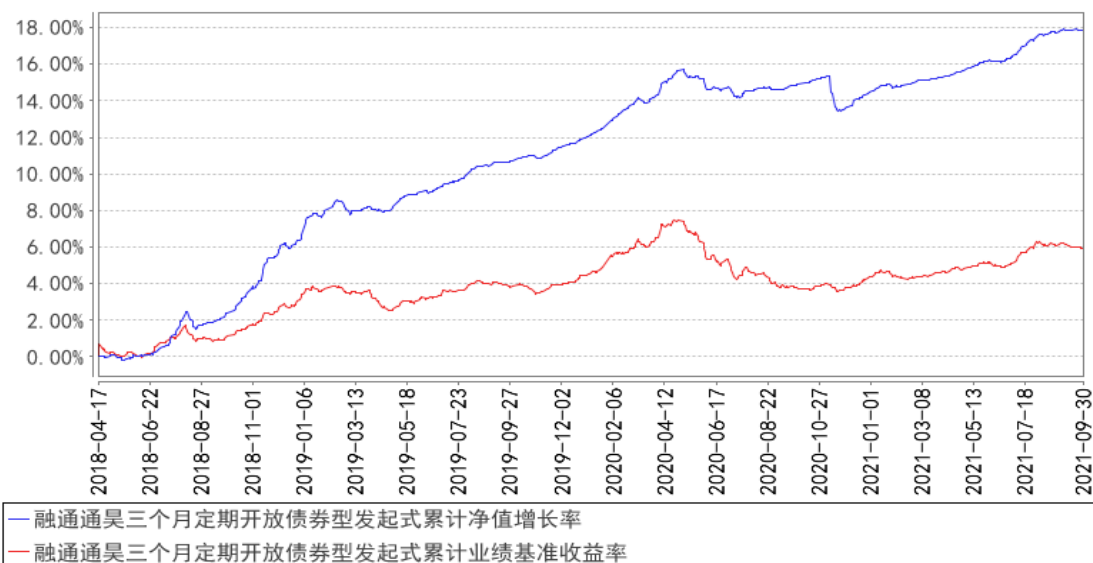
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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	1.30%	0.04%	0.83%	0.06%	0.47%	-0.02%
过去六个月	2.27%	0.03%	1.28%	0.05%	0.99%	-0.02%
过去一年	2.61%	0.07%	2.13%	0.04%	0.48%	0.03%
过去三年	15.14%	0.06%	4.80%	0.07%	10.34%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	17.87%	0.06%	5.96%	0.07%	11.91%	-0.01%

#### 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

融通通昊三个月定期开放债券型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



### 3.3 其他指标

无。

## § 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		
黄浩荣	本基金的基金经理	2019/10/11	-	7	黄浩荣先生，厦门大学管理学硕士，7 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2014 年 6 月加入融通基金管理有限公司，历任固定收益部固定收益研究员、融通通安债券型证券投资基金基金经理、融通通和债券型证券投资基金基金经理、融通通弘债券型证券投资基金基金经理、融通通祺债券型证券投资基金基金经理、融通通宸债券型证券投资基金基金经理、融通通福债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通通源短融债券型证券投资基金基金经理、融通通润债券型证券投资基金基金经理、融通通玺债券型证券投资基金基金经理、融通通穗债券型证券投资基金基金经理、融通通颐定期开放债券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、融通增利债券型证券投资基金基金经理、融通通远三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，现任融通汇财宝货币市场基金基金经理、融通易支付货币市场证券投资基金基金经理、融通现金宝货币市场基金基金经理、

					融通通慧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、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、融通通益混合型证券投资基金基金经理、融通通安债券型证券投资基金基金经理。
张一格	本基金的基金经理、固定收益投资总监	2019/10/11	-	15	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），15 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、融通通源短融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，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、融通多元收益一年持有期混合型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、基金业务相关的工作时间为计算标准。

#### 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

无。

#### 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

三季度经济恢复速度趋缓，并且在局部疫情反复背景下，月度数据出现波动，其中 8 月主要经济指标全面弱于市场预期，尤其社零增速明显放缓。PMI 数据逐步回落，9 月份数据滑落至荣枯线以下，经济复苏动能在房地产政策及基建增速不及预期情况下有所减弱。通胀方面，部分国内工业品价格在产能受限、总库存较低背景下，涨幅逐步走阔，8 月 PPI 同比 9.5%，短期 PPI 有望维持较高位。债券市场在经济下行和宽信用的预期中徘徊，长端收益率呈现震荡下行再小幅上行的走势。

货币政策基调在三季度继续保持中性，7 月份全面降准后打开了市场对货币宽松的想象空间，不过在 8、9 月地方债供给抬升背景下，整体资金利率中枢持续在高位震荡，并没有在降准后出现资金价格的下行，存单价格在 9 月份有所走高。

总体上，三季度经济环比走弱，呈现出一定的类滞胀格局，在操作上，增配了利率及高等级信用债比例，杠杆水平继续提升。

#### 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 1.0143 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.30%，业绩比较基准收益率为 0.83%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

截至本报告期末，本基金存在连续六十个工作日以上基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

## § 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	1,887,811,600.00	97.57
	其中：债券	1,887,811,600.00	97.57
	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	19,604,314.63	1.01
8	其他资产	27,373,563.77	1.41
9	合计	1,934,789,478.40	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

无。

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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

无。

## 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	33,205,500.00	2.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,261,222,000.00	84.02
	其中：政策性金融债	385,185,000.00	25.66
4	企业债券	64,382,600.00	4.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	225,178,500.00	15.00
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	243,400,000.00	16.21
9	其他	60,423,000.00	4.03
10	合计	1,887,811,600.00	125.76

**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	180211	18 国开 11	500,000	50,980,000.00	3.40
2	200212	20 国开 12	500,000	50,685,000.00	3.38
3	1820061	18 渤海银行 02	500,000	50,415,000.00	3.36
4	091900013	19 中信证券金融债 01	500,000	50,405,000.00	3.36
5	1928005	19 浦发银行小微债 01	500,000	50,370,000.00	3.36

**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**

无。

**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**

无。

**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**

无。

**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**

无。

**5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无。

**5.9.3 本期国债期货投资评价**

无。

**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：**

1、本基金投资的前十名证券中的 18 渤海银行 02，其发行主体为渤海银行股份有限公司。

根据发布的相关公告，该证券发行主体因违规经营、未依法履行职责，受到银保监会的处罚。

2、本基金投资的前十名证券中的 18 国开 11、20 国开 12、21 国开 01，其发行主体为国家开发银行。

根据发布的相关公告，该证券发行主体因违规经营、未依法履行职责，多次受到监管机构的



处罚。

3、本基金投资的前十名证券中的 19 浦发银行小微债 01，其发行主体为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据发布的相关公告，该证券发行主体因违规经营、未依法履行职责，多次受到监管机构的处罚。

4、本基金投资的前十名证券中的 20 浙商银行小微债 02，其发行主体为浙商银行股份有限公司。

根据发布的相关公告，该证券发行主体因违规经营、未依法履行职责，受到国家外汇管理局浙江省分局处罚。

5、本基金投资的前十名证券中的 21 广州银行 CD043，其发行主体为广州银行股份有限公司。

根据发布的相关公告，该证券发行主体因违规经营、未依法履行职责，受到广东银保监局的处罚。

6、本基金投资的前十名证券中的 21 上海银行，其发行主体为上海银行股份有限公司。

根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，多次受到监管机构的处罚。

投资决策说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

#### 5.10.2 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	27,382.22
2	应收证券清算款	1,559,889.09
3	应收股利	-
4	应收利息	25,786,292.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,373,563.77

#### 5.10.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 5.10.4 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.10.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	1,479,841,444.01
报告期期间基金总申购份额	113,479.75
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,479,954,923.76

## § 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	11,507,980.95
报告期期间买入/申购总份额	113,479.75
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	11,621,460.70
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.79

### 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	2021-9-28	113,479.75	115,079.81	-
合计			113,479.75	115,079.81	

## § 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	11,621,460.70	0.79	10,000,000.00	0.68	不少于三年
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	11,621,460.70	0.79	10,000,000.00	0.68	-

注：本基金发起资金持有份额起始日为 2018 年 4 月 17 日。

## § 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	20210701-20210930	1,468,333,463.06	-	-	1,468,333,463.06	99.21
个人	-	-	-	-	-	-	-
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单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会《关于准予融通通昊定期开放债券型证券投资基金变更注册的批复》
- (二) 《关于融通通昊定期开放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) 《融通通昊三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- (四) 《融通通昊三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- (五) 《融通通昊三个月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) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (七) 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，或登录本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查阅。

融通基金管理有限公司

2021 年 10 月 26 日