

融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金  
2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 1 月 21 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 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 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	融通通跃一年定开债券发起式
基金主代码	012732
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 27 日
报告期末基金份额总额	2,010,062,131.39 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。封闭期投资策略主要包括资产配置策略、利率策略、信用策略、类属配置与个券选择策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，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，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
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

## § 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 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日）
--------	---------------------------------------

1. 本期已实现收益	18,039,522.28
2. 本期利润	30,597,643.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0152
4. 期末基金资产净值	2,023,043,339.73
5. 期末基金份额净值	1.0065

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。

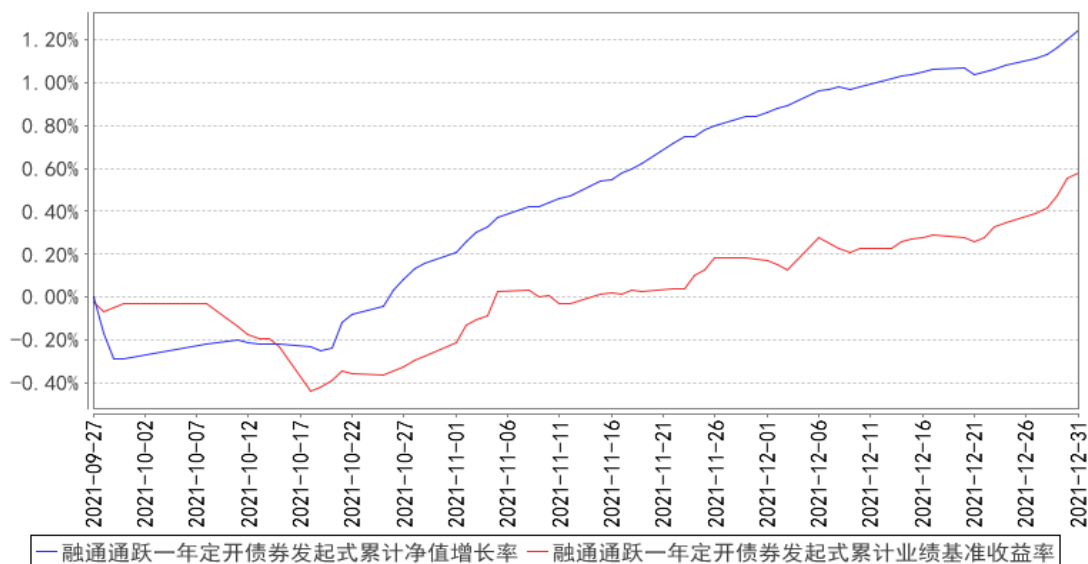
### 3.2 基金净值表现

#### 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	1.54%	0.03%	0.60%	0.05%	0.94%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	1.24%	0.04%	0.58%	0.05%	0.66%	-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

融通通跃一年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：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 9 月 27 日，至报告期末合同生效未满一年；

2、本基金的建仓期为自合同生效日起 6 个月，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

### 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		
许富强	本基金的基金经理	2021 年 09 月 27 日	-	10 年	许富强先生，北京大学经济学硕士，10 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2011 年 7 月加入融通基金管理有限公司，历任固定收益部研究员、专户投资经理、融通通穗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、融通通优债券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，现任融通通鑫灵活配置混合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、融通可转债债券型证券投资基金基金经理、融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通增享纯债债券型证券投资基金基金经理、融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通增鑫债券型证券投资基金基金经理、融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理、融通通恒 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通通跃一年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

四季度国债收益率先上后下，主要受经济基本面、通胀预期以及货币政策预期影响。从经济基本面来看，当前经济处于下行阶段，从地产基建投资、消费和进出口分项来看，投资对经济拖累较大，后续随着地产政策边际放松、基建发力等政策落地，预计未来投资边际回暖。贸易层面，进出口数据均持续较强，考虑到供给端海外缺口依然存在，有望带来我国出口份额持续处于高位，因此短期内出口或仍可在高位。通胀方面，随着工业品价格回落，PPI 见顶回落，但部分工业品供需仍偏紧，价格回落偏慢。货币政策方面，四季度货币政策基调宽松，12 月 6 日全面降准 0.5 个百分点，置换 MLF 的同时也稳定了市场预期。市场对后续货币政策进一步发力存在非常强的预期。展望未来，债券市场多空并存，一方面是经济下行压力加大，货币政策预期进一步放松；另一方面，收益率处在低位，市场预期较为充足。随着维稳政策持续出台，宽信用和稳增长的效果将陆续体现。

组合以中高资质信用债和资产支持证券为主，封闭期高杠杆运行。短期来看银行间流动性仍然充裕，债券组合仍将以票息收入为主，维持高杠杆水平，获取套息收益。

### 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 1.0065 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.54%，业绩比较基准收益率为 0.60%。

### 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	3,082,731,600.00	96.54
	其中：债券	2,699,768,600.00	84.54
	资产支持证券	382,963,000.00	11.99
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	56,300,000.00	1.76
	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	2,223,024.52	0.07
8	其他资产	52,054,705.14	1.63
9	合计	3,193,309,329.66	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	503,367,600.00	24.88
5	企业短期融资券	280,700,000.00	13.88
6	中期票据	1,915,701,000.00	94.69
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,699,768,600.00	133.45

## 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	163488	20 扬子 G1	1,500,000	149,910,000.00	7.41
2	101756048	17 皖交控 MTN002	1,000,000	102,530,000.00	5.07
3	102101166	21 荆门城投 MTN002	1,000,000	102,470,000.00	5.07
4	102101239	21 淮安国投 MTN002	1,000,000	101,960,000.00	5.04
5	102100976	21 台州经济 MTN001	1,000,000	101,880,000.00	5.04

#### 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

序号	证券代码	证券名称	数量 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	169548	建花 15A	1,900,000	191,976,000.00	9.49
2	159817	19 电建优	1,500,000	150,435,000.00	7.44
3	169253	中能化 1A	400,000	40,552,000.00	2.00

#### 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。

##### 5.10.2 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	63,354.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	51,991,350.20

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,054,705.14

### 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	2,010,003,364.21
报告期期间基金总申购份额	58,767.18
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	2,010,062,131.39

## § 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	10,002,361.10
报告期期间买入/申购总份额	58,755.41
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	10,061,116.51
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.50

### 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	2021-12-15	58,755.41	59,013.93	-
合计			58,755.41	59,013.93	-

## § 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	10,061,116.51	0.50	10,002,361.10	0.50	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	10,061,116.51	0.50	10,002,361.10	0.50	-

### § 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	20211001-20211231	1,999,999,000.00	-	-	1,999,999,000.00	99.50
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。							

#### 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) 中国证监会批准融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 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> 查阅。

融通基金管理有限公司

2022 年 1 月 21 日