

融通增享纯债债券型证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：南京银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 20 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。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 18 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 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	融通增享纯债债券	
基金主代码	007546	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 11 月 8 日	
报告期末基金份额总额	907,157,444.60 份	
投资目标	本基金在严格控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，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的投资策略等部分。	
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，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。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	南京银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	融通增享纯债债券 A	融通增享纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	007546	017555
报告期末下属分级基金的份额总额	907,154,533.58 份	2,911.02 份

## § 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（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）	
	融通增享纯债债券 A	融通增享纯债债券 C

1. 本期已实现收益	2,138,917.02	271,968.63
2. 本期利润	1,802,064.34	299,631.80
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0033	0.0026
4. 期末基金资产净值	1,001,957,353.41	3,203.95
5. 期末基金份额净值	1.1045	1.1006

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。

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

融通增享纯债债券 A

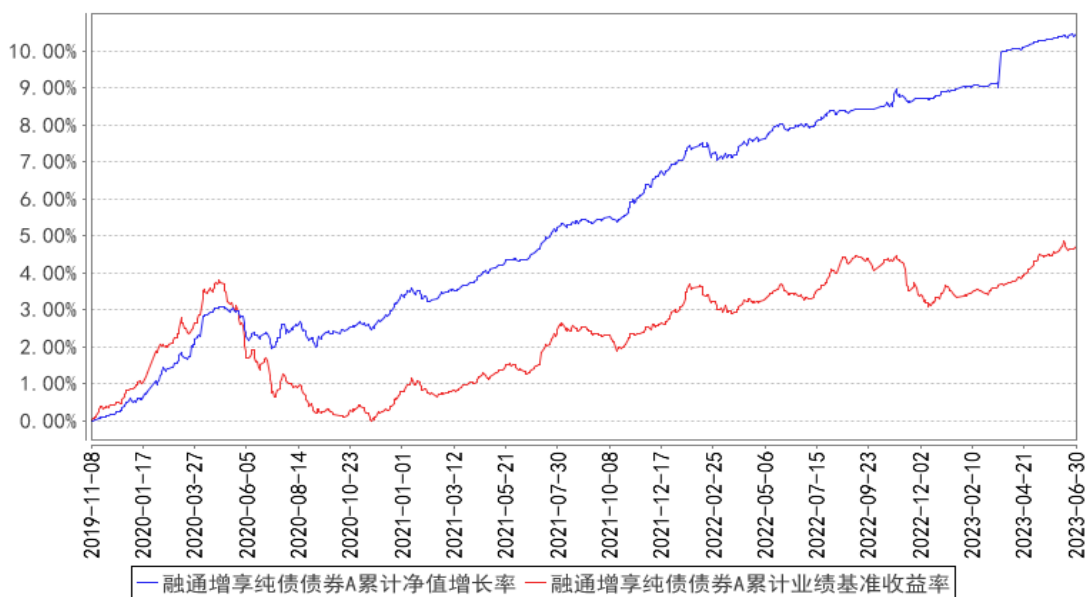
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.39%	0.02%	0.94%	0.04%	-0.55%	-0.02%
过去六个月	1.43%	0.08%	1.22%	0.04%	0.21%	0.04%
过去一年	2.24%	0.06%	1.35%	0.05%	0.89%	0.01%
过去三年	7.91%	0.05%	2.99%	0.05%	4.92%	0.00%
自基金合同生效起至今	10.45%	0.05%	4.71%	0.06%	5.74%	-0.01%

融通增享纯债债券 C

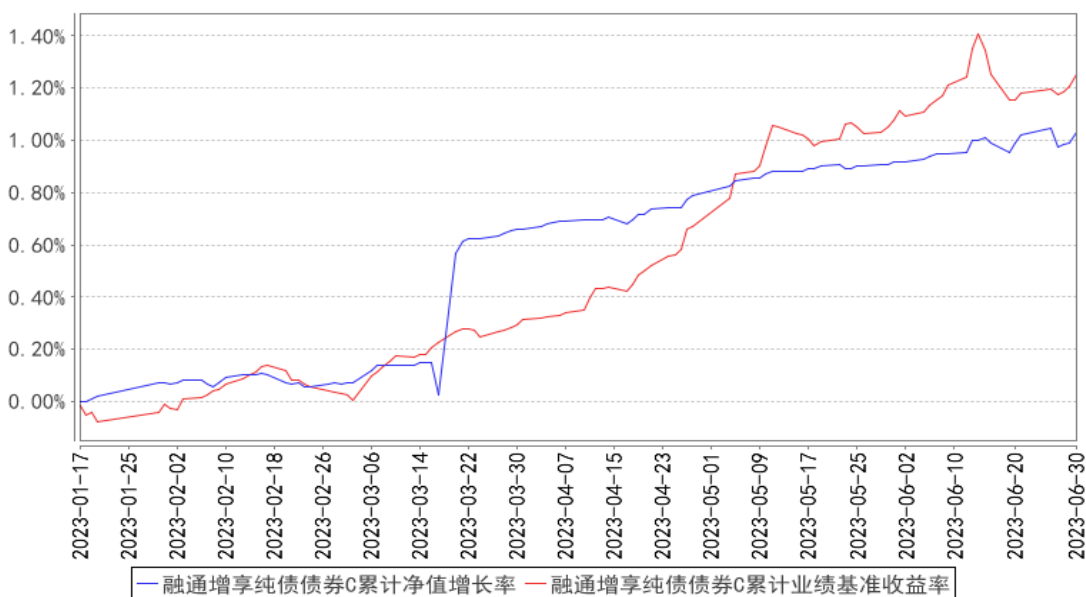
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.36%	0.02%	0.94%	0.04%	-0.58%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.03%	0.06%	1.25%	0.03%	-0.22%	0.03%

#### 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

融通增享纯债债券A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



融通增享纯债债券C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：本基金于 2023 年 1 月 13 日增加 C 类份额，该类份额首次确认日为 2023 年 1 月 17 日，故本基金 C 类份额的统计期间为 2023 年 1 月 17 日至本报告期末。

### 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	2019 年 11 月 8	-	12 年	许富强先生，北京大学经济学硕士，12

	基金经理	日		<p>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、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、融通通宸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、融通可转债债券型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、融通通鑫债券型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。</p>
--	------	---	--	--

注：1、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。

2、2023 年 7 月 12 日，本基金管理人发布了《融通增享纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告》，自 2023 年 7 月 12 日起，基金管理人增聘刘舒乐担任本基金的基金经理，同时许富强先生不再担任本基金的基金经理。

#### 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

二季度国内债市收益率加速下行，主要原因是前期对于经济的预期较强，特别是对政策刺激的预期较强。一季度之后，强预期逐步得到修正，市场对经济基本面的预期重回悲观，债券收益率也开始企稳下行。权益市场板块之间分化严重，顺周期板块回调明显。具体来看，二季度经济数据环比走弱，恢复性动能释放之后内生动力不足。经济政策方面，货币政策持续宽松，存款利率下调，超预期下调 OMO 和 MLF 利率，银行间市场流动性充裕。各项扩大内需的政策也逐步出台。总体来看，政策对经济依然采取呵护，但未出台超强的刺激政策。

组合一季度应对了较大的赎回冲击，目前配置以短久期利率债为主。短期来看银行间流动性量较足但是价格有所抬升，债券组合将保持较高的灵活性，以票息收入为主，同时我们也将继续关注债市的交易性机会，在适当机会通过中长久期利率品种博取超额收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通增享纯债债券 A 基金份额净值为 1.1045 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 0.94%；

截至本报告期末融通增享纯债债券 C 基金份额净值为 1.1006 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.36%，同期业绩比较基准收益率为 0.94%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至 2023 年 5 月 12 日，本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

### § 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	1,050,427,952.06	97.95
	其中：债券	1,050,427,952.06	97.95

	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	20,005,617.46	1.87
	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	2,030,629.94	0.19
8	其他资产	2,773.33	0.00
9	合计	1,072,466,972.79	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	303,357.78	0.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	687,057,753.70	68.57
	其中：政策性金融债	526,853,490.41	52.58
4	企业债券	65,614,625.77	6.55
5	企业短期融资券	10,142,606.56	1.01
6	中期票据	287,309,608.25	28.67
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,050,427,952.06	104.84

## 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	230401	23 农发 01	1,500,000	151,558,109.59	15.13
2	092218001	22 农发清发 01	1,500,000	151,362,739.73	15.11
3	190203	19 国开 03	1,000,000	102,056,164.38	10.19

4	220211	22 国开 11	1,000,000	101,601,287.67	10.14
5	2120082	21 稠州银行小微债 01	950,000	98,861,627.67	9.87

#### 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

1、本基金投资的前十名证券中的 21 稠州银行小微债 01，其发行主体为浙江稠州商业银行股份有限公司。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，受到国家外汇管理局浙江省分局的处罚。

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	2,773.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-



6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,773.33

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

项目	融通增享纯债债券 A	融通增享纯债债券 C
报告期期初基金份额总额	342,670.10	2,010.27
报告期期间基金总申购份额	1,042,891,993.30	773,431,301.19
减：报告期期间基金总赎回份额	136,080,129.82	773,430,400.44
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	907,154,533.58	2,911.02

§ 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

项目	融通增享纯债债券 A	融通增享纯债债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	184,928.34	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
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	184,928.34	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.02	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 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

投资	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
----	----------------	------------

者类别	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	20230515-20230630	-	906,863,154.08	-	906,863,154.08	99.97
	2	20230401-20230514	184,928.34	-	-	184,928.34	0.02
	3	20230515-20230522	-	636,942,675.16	636,942,675.16	-	-
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份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

## 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

- (一) 中国证监会批准融通增享纯债债券型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通增享纯债债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通增享纯债债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通增享纯债债券型证券投资基金招募说明书》及其更新
- (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

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 9.3 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

2023 年 7 月 20 日