

融通通安债券型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 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：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 18 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 16 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	融通通安债券
基金主代码	002807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 7 月 21 日
报告期末基金份额总额	997,620,095.47 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	宁波银行股份有限公司

## § 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	7,538,442.16
2. 本期利润	11,819,059.66
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0118
4. 期末基金资产净值	1,014,023,544.61

5. 期末基金份额净值	1.016
-------------	-------

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。

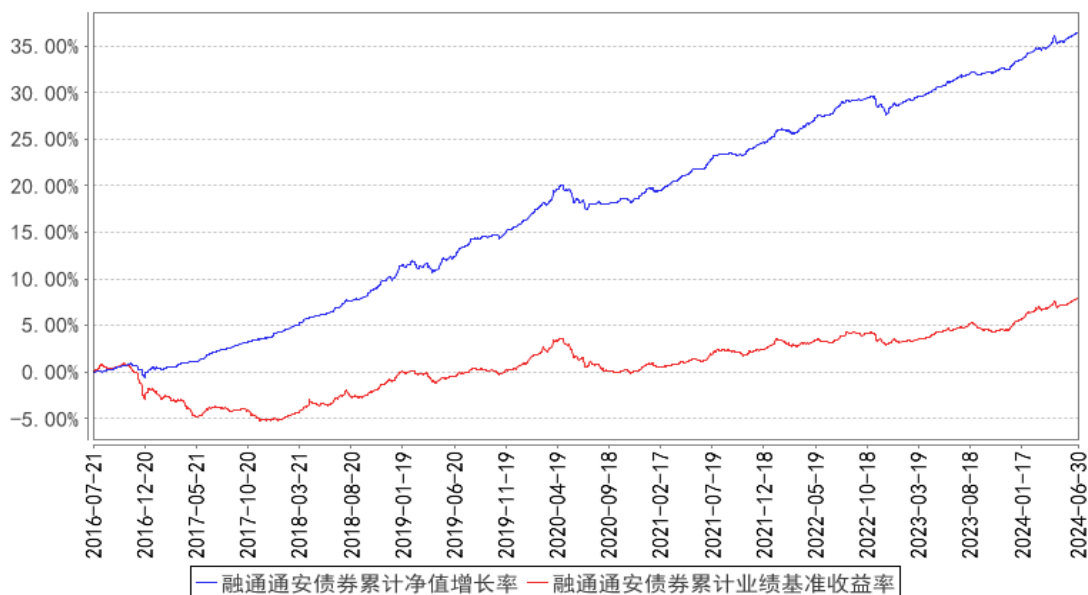
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	1.16%	0.07%	1.06%	0.07%	0.10%	0.00%
过去六个月	2.36%	0.07%	2.42%	0.07%	-0.06%	0.00%
过去一年	3.89%	0.06%	3.27%	0.06%	0.62%	0.00%
过去三年	11.75%	0.06%	6.58%	0.05%	5.17%	0.01%
过去五年	20.98%	0.06%	8.35%	0.06%	12.63%	0.00%
自基金合同 生效起至今	36.46%	0.06%	7.98%	0.07%	28.48%	-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

融通通安债券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	2021 年 4 月 15 日	-	10 年	黄浩荣先生，厦门大学管理学硕士，10 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、融通通益混合型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、融通通安债券型证券投资基金基金经理、融通通华五年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。
雷冠中	本基金的基金经理	2024 年 1 月 4 日	-	7 年	雷冠中先生，经济学硕士，7 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2017 年 7 月至 2023 年 8 月在汇添富基金管理股份有限公司工作，担任助理固定收益分析师。2023 年 8 月加入融通基金管理有限公司。现任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、融通通安债券型证券投资基金基金经理、融通增益债券型证券投资基金基金经理、融通中证中诚信央企信用

					债指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	----------------

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、2024 年 7 月 8 日，本基金管理人发布了《融通通安债券型证券投资基金基金经理变更公告》，自 2024 年 7 月 8 日起，黄浩荣不再担任本基金的基金经理，雷冠中继续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

**债券市场回顾：**2024 年 2 季度债券市场走出轮动行情，4 月份后受存单利率下行及非银欠配等机构行为影响，各项信用利差压缩到极致，同时利率债也有所下行，但表现不及信用债。4 月底在季节性因素和监管行为影响下，市场出现快速调整，利率债调整幅度较大。随后随着资金面宽松，市场收益率再次下行，利差较高的信用债品种领先利率债，直到 6 月中旬，伴随经济基本面没有进一步走强，长久期利率债出现快速补涨。

**基金操作：**回顾 2024 年 2 季度的基金操作，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资策略和投资流程进行了规范运作。操作上以品种轮动作为主要来源，在同业存单、企业债、

金融债和利率债之间进行了相关轮动获取超额利差收窄带来的收益，同时保持产品久期维持在中性以上获取无风险收益率下行带来的资本利得。

#### 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 1.016 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.16%，业绩比较基准收益率为 1.06%。

#### 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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

### § 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	1,236,064,450.21	99.63
	其中：债券	1,236,064,450.21	99.63
	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	4,558,966.97	0.37
8	其他资产	-	-
9	合计	1,240,623,417.18	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	121,419,375.35	11.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	195,923,482.57	19.32
	其中：政策性金融债	50,337,950.82	4.96
4	企业债券	20,348,684.93	2.01
5	企业短期融资券	130,804,448.69	12.90
6	中期票据	620,198,285.92	61.16
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	147,370,172.75	14.53
9	其他	-	-
10	合计	1,236,064,450.21	121.90

#### 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	130019	13 付息国债 19	700,000	98,030,815.22	9.67
2	102102302	21 北京国资 MTN002	600,000	61,465,042.62	6.06
3	2021044	20 无锡农商永续债	500,000	53,187,786.89	5.25
4	101901572	19 北排水 MTN002	500,000	51,598,688.52	5.09
5	102101895	21 深圳特发 MTN001	500,000	51,414,245.90	5.07

#### 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

##### 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 20 无锡农商永续债，其发行主体为无锡农村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，受到国家金融监督管理总局无锡监管分局的处罚。

2、本基金投资的前十名证券中的 23 江南农商绿色债，其发行主体为江苏江南农村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，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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

无。

### 5.10.3 其他资产构成

无。

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.10.6 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	997,476,748.43
报告期期间基金总申购份额	764,308.85
减：报告期期间基金总赎回份额	620,961.81
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	997,620,095.47



## § 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

无。

### 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	20240401-20240630	994,521,365.08	-	-	994,521,365.08	99.69
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通安债券型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通通安债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通通安债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通通安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

2024 年 7 月 18 日