

# 富荣富合一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

2022年第2季度报告

2022年06月30日

基金管理人:富荣基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2022年07月21日

## 目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	6
4.3 公平交易专项说明	6
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	6
4.5 报告期内基金的业绩表现	7
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	7
§5 投资组合报告	7
5.1 报告期末基金资产组合情况	7
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	8
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十名股票投资明细	8
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	8
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	8
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	9
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	9
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	9
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	9
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	9
5.11 投资组合报告附注	9
§6 开放式基金份额变动	10
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	10
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	11
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	11
§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况	11
§9 影响投资者决策的其他重要信息	11
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	11
9.2 影响投资者决策的其他重要信息	12
§10 备查文件目录	12
10.1 备查文件目录	12
10.2 存放地点	12
10.3 查阅方式	12

## § 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。

基金托管人中国民生股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年7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2022年4月1日起至2022年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富荣富合一年定开债
基金主代码	008522
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月31日
报告期末基金份额总额	999,998,000.00份
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	封闭期内，本基金通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境、市场利率、信用债券发行人基本面等方面进行深入调研和综合分析，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。本基金采用的投资策略包括：资产配置策略、利率预期策略、信用债券投资策略、收益率利差策略、属类配置策略、个券选择策略、资产支持证券的投资策略等。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	中债综合指数（总财富）收益率×90%+1年期定期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	富荣基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

### § 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（2022年04月01日 - 2022年06月30日）
1. 本期已实现收益	6,501,779.66
2. 本期利润	7,500,623.95
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0075
4. 期末基金资产净值	1,035,609,593.19
5. 期末基金份额净值	1.0356

注：①上述基金业绩指标不包括持有人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；

②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。

#### 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

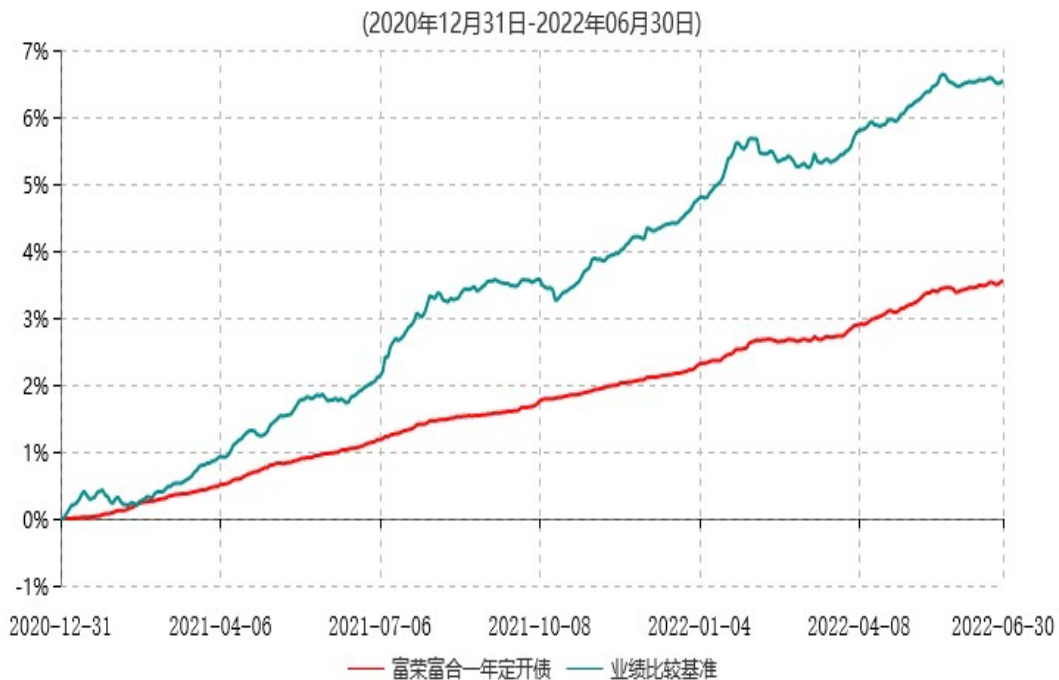
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.73%	0.02%	0.98%	0.03%	-0.25%	-0.01%
过去六个月	1.25%	0.02%	1.72%	0.05%	-0.47%	-0.03%

月						
过去一年	2.40%	0.01%	4.44%	0.05%	-2.04%	-0.04%
自基金合同生效起至今	3.56%	0.01%	6.55%	0.04%	-2.99%	-0.03%

注：本基金的业绩比较基准为中债综合指数（总财富）收益率×90%+1年期定期存款利率（税后）×10%

### 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

富荣富合一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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	说明
		任职	离任		

		日期	日期	年限	
王丹	固定收益部总经理助理、 基金经理	2020- 12-31	-	1 0. 5	北京大学工商管理硕士， 厦门大学理学学士，持有 基金从业资格证书，中国 国籍。曾任寰富投资咨询 上海有限公司金融衍生品 交易员，长盛基金管理有 限公司债券交易员，嘉实 基金管理有限公司投资经 理，华融证券股份有限公司 固收研究、交易主管。2 019年6月21日加入富荣基 金。

#### 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循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3日内、5日内），对旗下所有投资组合的同向交易价差情况进行分析，报告期内未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾二季度，债市整体基本延续震荡走势为主。二季度初上海疫情形势严峻，受疫情影响经济筑底反弹窗口拉长，同时二季度央行货币政策持续保持合理充裕，资金面适

度宽松的格局得以持续保持。从基本面和经济政策方面看，二季度稳增长政策显著加码，尤其体现在地产和消费等领域，经济数据也体现一定结构性修复迹象，专项债提速发行或推高二季度基建投资增速至年内高点。从货币政策方面看，尽管当前央行仍对通胀、汇率走势及资本流动变化保持一定关注，但国内稳增长和充分就业仍是政策核心目标；政策工具选择方面，价格型工具使用较为谨慎，传统数量型政策工具会维持，结构性工具和利率市场化传导机制仍将是重点。

展望三季度，首先持续关注二季度强政策落地情况及实质拉动经济效果，关注经济企稳的速度和幅度，进一步验证“宽信用”的预期能否在三季度得以加强，经济数据企稳的幅度与市场预期之间的预期差可能是市场博弈的要素之一。大体上，三季度稳增长政策有望持续，但政策力度边际压力有所释放，关注央行三季度跨周期调节操作情况。债券市场表现来看，可能面临一定调整压力，组合更倾向于中杠杆、中久期策略，以寻找绝对收益配置机会为主。

本基金以1年以内利率债券投资为主，组合整体久期与基准偏离将控制在一定幅度内，力争给投资者稳定的预期回报。在一季度我们持续通过新老债券利差策略、骑乘策略等高安全性的策略增强组合收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣富合一年定开债基金份额净值为1.0356元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.73%，同期业绩比较基准收益率为0.98%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年。

### § 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	1,107,643,896.07	99.96
	其中：债券	1,107,643,896.07	99.96
	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	494,438.76	0.04
8	其他资产	-	0.00
9	合计	1,108,138,334.83	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

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	911,649,076.81	88.03
	其中：政策性金融债	911,649,076.81	88.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	195,994,819.26	18.93
9	其他	-	-
10	合计	1,107,643,896.07	106.96

## 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	180309	18进出09	1,800,000	184,236,608.22	17.79
2	112206145	22交通银行CD145	1,000,000	97,950,136.16	9.46
3	210322	21进出22	800,000	81,916,032.88	7.91
4	190208	19国开08	700,000	73,752,441.10	7.12
5	210203	21国开03	700,000	72,089,452.05	6.96

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行、国家开发银行、农业发展银行、交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
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	-

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	999,998,000.00
报告期期间基金总申购份额	-
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（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	999,998,000.00

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

## § 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	9,999,000.00
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	9,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.00

注：报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，基金总份额为分级总份额。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 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	9,999,000.00	1.00%	9,999,000.00	1.00%	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	989,999,000.00	99.00%	0.00	0.00%	-
合计	999,998,000.00	100.00%	9,999,000.00	1.00%	-

## § 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	1	20220401 - 20220630	989,999,000.00	-	-	989,999,000.00	99.00%

构						
产品特有风险						
<p>本报告期本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况，未来或存在如下风险：（1）赎回申请延期办理的风险 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。（2）基金资产净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。（3）提前终止基金合同的风险，多名高比例投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，根据本合同约定，基金合同生效日起三年后继续存续的，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并六个月内召集基金份额持有人大会进行表决。（4）基金合同生效满三年后的对应日，若本基金资产净值低于2亿元，基金合同应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续基金合同期限。（5）基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，基金投资可能面临一定困难。</p>						

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内未出现影响投资者决策的其他重要信息。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 10.1.1 中国证监会批准富荣富合一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金设立的文件；
- 10.1.2 《富荣富合一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 10.1.3 《富荣富合一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 10.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 10.1.5 报告期内富荣富合一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 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。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富荣基金管理有限公司，客服热线：4006855600。

富荣基金管理有限公司

2022年07月21日