
中融融盛双盈一年封闭运作债券型证券投资基金

2023年第2季度报告

2023年06月30日

基金管理人:中融基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2023年07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。

基金托管人中国农业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及其更新。

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2023年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中融融盛双盈一年封闭债券
基金主代码	015477
基金运作方式	契约型基金。基金合同生效后的前一年为封闭运作期，封闭运作期自基金合同生效日起至一年后的年度对日（如该对应日期为非工作日或日历年度中不存在该对应日期的，则顺延至下一工作日）的前一日（含）止。在封闭运作期内，本基金不办理申购、赎回业务，也不上市交易。封闭运作期届满后，无需召开基金份额持有人大会审议，本基金转为开放式运作，基金名称变更为“中融融盛双盈债券型证券投资基金”，可以办理申购、赎回业务。除此之外，本基金的基金费率、基金的投资范围和投资策略等均不变。
基金合同生效日	2022年08月31日
报告期末基金份额总额	344,893,375.36份
投资目标	在注重资产安全性和流动性的前提下，积极主动调整投资组合，追求基金资产的长期稳定增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	1、大类资产配置 2、债券投资策略

	3、股票投资策略 4、存托凭证投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、国债期货投资策略 7、信用衍生品投资策略	
业绩比较基准	中债综合指数(全价)收益率*90%+沪深300指数收益率*8%+恒生指数收益率*2%	
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混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。 本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	中融基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中融融盛双盈一年封闭债券A	中融融盛双盈一年封闭债券C
下属分级基金的交易代码	015477	015478
报告期末下属分级基金的份额总额	312,664,303.66份	32,229,071.70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04月01日 - 2023年06月30日)	
	中融融盛双盈一年封闭债券A	中融融盛双盈一年封闭债券C
1.本期已实现收益	3,047,840.98	281,104.80
2.本期利润	2,360,030.48	210,473.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0075	0.0065
4.期末基金资产净值	314,455,838.13	32,306,289.61
5.期末基金份额净值	1.0057	1.0024

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、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，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

中融融盛双盈一年封闭债券A净值表现

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	0.75%	0.10%	0.29%	0.09%	0.46%	0.01%
过去六个月	2.47%	0.10%	1.00%	0.09%	1.47%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.57%	0.10%	-0.11%	0.11%	0.68%	-0.01%

中融融盛双盈一年封闭债券C净值表现

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	0.65%	0.10%	0.29%	0.09%	0.36%	0.01%
过去六个月	2.26%	0.10%	1.00%	0.09%	1.26%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.24%	0.09%	-0.11%	0.11%	0.35%	-0.02%

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

中融融盛双盈一年封闭债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年08月31日-2023年06月30日)



中融融盛双盈一年封闭债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年08月31日-2023年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。基金合同生效日起至本报告期末不满一年。

§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		
哈默	中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融恒鑫纯债债券型证券投资基金、中融睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、中融景盛一年持有期混合型证券投资基金、中融景泓一年持有期混合型证券投资基金、中融景惠混合型证券投资基金、中融恒通纯债债券型证券投资基金、中融融盛双盈一年封闭运作债券型证券投资基金的基金经理。	2022-08-31	-	15	哈默女士，中国国籍，毕业于中国人民大学国民经济学专业，硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限15年。2007年7月至2019年1月历任银华基金管理股份有限公司交易管理部交易员、固定收益部债券研究员、基金经理助理、基金经理。2019年1月加入中融基金管理有限公司，现任绝对收益部基金经理。
钱文成	中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、中融景瑞一年持有期混合型证券投资基金、中融景颐6个月持有期混合型证券投资基金、中融景盛一年持有期混合型证券投资基金、中融景泓一年持有期混合型证券投资基金、中融景	2022-08-31	-	15	钱文成先生，中国国籍，毕业于南开大学遗传学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限15年。2007年7月至2020年6月历任天弘基金管理有限公司股票投资研究部研究员、基金经理；2020年7月加入中融基金管理有限公司，现任公司价值投资总监兼价值投资部总经理。

	惠混合型证券投资基金、中融兴鸿优选一年封闭运作混合型证券投资基金、中融融盛双盈一年封闭运作债券型证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金的基金经理及公司价值投资总监兼价值投资部总经理。				
潘巍	中融盈泽中短债债券型证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融融盛双盈一年封闭运作债券型证券投资基金、中融益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、中融益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、中融景瑞一年持有期混合型证券投资基金的基金经理及绝对收益部总经理	2022-09-14	-	14	潘巍先生，中国国籍，毕业于美国哥伦比亚大学运筹学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限14年。2009年6月至2013年9月曾任中信证券股份有限公司资产管理部股票研究员、债券研究员；2013年9月至2015年8月曾任中华联合保险控股股份有限公司资产管理中心投资经理；2015年8月至2016年11月曾任华夏基金管理有限公司机构债券投资部投资经理；2016年12月至2022年3月曾任安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理、基金经理。2022年3月加入中融基金管理有限公司，现任绝对收益部总经理。

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券基金从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行。公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

进入二季度以来，整体经济复苏动能边际有所减弱，消费恢复出现结构性分化。当前政策定力较强，在中长期经济结构调整与短期稳增长扩有效需求之间寻找平衡。二季度资金面比较宽裕，利率债和信用债均有不错的表现，但权益市场除了部分热点，大部分板块表现不佳。本组合的债券部分维持了高杠杆和一定的久期，权益部分做了板块权重上的调整，力争使组合的结构更加均衡，降低市场波动带来的冲击。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融融盛双盈一年封闭债券A基金份额净值为1.0057元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.75%，同期业绩比较基准收益率为0.29%；截至报告期末中融融盛双盈一年封闭债券C基金份额净值为1.0024元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.65%，同期业绩比较基准收益率为0.29%。

§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	34,572,012.58	5.24
	其中：股票	34,572,012.58	5.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	616,088,032.42	93.45
	其中：债券	616,088,032.42	93.45
	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	3,059,847.68	0.46
8	其他资产	5,519,048.93	0.84
9	合计	659,238,941.61	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为8,179,189.29元，占净值比例2.36%。

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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	892,510.00	0.26
C	制造业	18,540,331.84	5.35
D	电力、热力、燃气及水生 生产和供应业	225,225.00	0.06
E	建筑业	1,199,460.00	0.35
F	批发和零售业	744,169.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	105,160.00	0.03
H	住宿和餐饮业	186,296.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术 服务业	1,062,160.52	0.31

J	金融业	1,839,374.41	0.53
K	房地产业	881,220.00	0.25
L	租赁和商务服务业	15,060.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	359,934.40	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	333,472.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	8,450.12	0.00
S	综合	-	-
	合计	26,392,823.29	7.61

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
非日常生活消费品	967,101.71	0.28
日常消费品	324,887.31	0.09
能源	1,005,004.30	0.29
金融	2,384,590.63	0.69
医疗保健	1,131,859.98	0.33
工业	95,590.89	0.03
信息技术	113,772.33	0.03
通讯业务	1,010,102.85	0.29
公用事业	324,057.53	0.09
房地产	822,221.76	0.24
合计	8,179,189.29	2.36

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688114	华大智造	7,000	605,920.00	0.17
2	02601	中国太保	28,000	522,762.66	0.15

3	002126	银轮股份	29,000	513,300.00	0.15
4	02257	圣诺医药-B	9,550	487,351.71	0.14
5	688383	新益昌	3,400	473,348.00	0.14
6	06066	中信建投证券	63,000	469,324.70	0.14
7	601567	三星医疗	37,000	467,310.00	0.13
8	601881	中国银河	39,981	464,179.41	0.13
9	00388	香港交易所	1,700	462,686.44	0.13
10	600496	精工钢构	120,000	447,600.00	0.13

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	10,772,548.51	3.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,242,445.48	4.40
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	298,082,572.93	85.96
5	企业短期融资券	46,903,004.79	13.53
6	中期票据	213,055,248.31	61.44
7	可转债（可交换债）	27,923,774.04	8.05
8	同业存单	-	-
9	其他	4,108,438.36	1.18
10	合计	616,088,032.42	177.67

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	149168	20深投04	200,000	20,501,830.14	5.91
2	152613	20宜国04	200,000	20,498,326.58	5.91
3	102001922	20晋江国资MTN003	180,000	18,594,695.34	5.36
4	102200145	22陕煤化MTN006	180,000	18,289,947.54	5.27
5	137777	22义乌02	180,000	18,218,056.44	5.25

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

注：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

注：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

注：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**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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**

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,163.38
2	应收证券清算款	5,399,008.48

3	应收股利	106,877.07
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,519,048.93

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	132026	G三峡EB2	2,920,754.82	0.84
2	113052	兴业转债	2,624,197.17	0.76
3	113065	齐鲁转债	2,618,950.99	0.76
4	110059	浦发转债	2,269,937.75	0.65
5	113044	大秦转债	2,171,703.89	0.63
6	110073	国投转债	2,033,779.36	0.59
7	113056	重银转债	1,722,043.96	0.50
8	127018	本钢转债	1,328,719.84	0.38
9	113062	常银转债	1,207,142.93	0.35
10	110064	建工转债	1,092,930.35	0.32
11	127032	苏行转债	1,087,617.43	0.31
12	110061	川投转债	874,513.70	0.25
13	132018	G三峡EB1	851,165.75	0.25
14	113037	紫银转债	679,718.89	0.20
15	110053	苏银转债	502,864.66	0.15
16	113042	上银转债	432,864.66	0.12
17	110085	通22转债	430,924.70	0.12
18	113631	皖天转债	419,812.89	0.12
19	110063	鹰19转债	389,468.32	0.11
20	127029	中钢转债	372,147.39	0.11
21	127028	英特转债	316,195.07	0.09
22	127058	科伦转债	302,355.29	0.09
23	123107	温氏转债	301,430.47	0.09
24	127027	能化转债	241,229.86	0.07

25	127040	国泰转债	218,916.11	0.06
26	110052	贵广转债	140,123.54	0.04
27	113021	中信转债	138,137.56	0.04
28	113057	中银转债	91,214.76	0.03

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	中融融盛双盈一年封闭 债券A	中融融盛双盈一年封闭 债券C
报告期期初基金份额总额	312,664,303.66	32,229,071.70
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	312,664,303.66	32,229,071.70

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

注：本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融融盛双盈一年封闭运作债券型证券投资基金注册的批复文件
- (2) 《中融融盛双盈一年封闭运作债券型证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融融盛双盈一年封闭运作债券型证券投资基金托管协议》
- (4) 关于申请募集中融融盛双盈一年封闭运作债券型证券投资基金之法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (7) 中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：中融基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000, (010) 56517299。

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司
2023年07月20日