

融通中证中诚信央企信用债指数证券投资基金
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|--|------------------|
| 基金简称 | 融通中证中诚信央企信用债指数 | |
| 基金主代码 | 017561 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2023 年 3 月 28 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 3,098,260,326.09 份 | |
| 投资目标 | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 | |
| 投资策略 | 本基金投资策略主要包括债券指数化投资策略、其他债券投资策略、国债期货交易策略等部分。 | |
| 业绩比较基准 | 中证中诚信央企信用债指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。 | |
| 基金管理人 | 融通基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 融通中证中诚信央企信用债指数 A | 融通中证中诚信央企信用债指数 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 017561 | 017562 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,098,259,692.33 份 | 633.76 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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|------------------|
| | 融通中证中诚信央企信用债指数 A | 融通中证中诚信央企信用债指数 C |
| 1. 本期已实现收益 | 25,794,850.14 | 5.06 |
| 2. 本期利润 | 3,369,817.52 | 1.55 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0009 | 0.0023 |
| 4. 期末基金资产净值 | 3,191,899,082.19 | 662.99 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0302 | 1.0461 |

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

融通中证中诚信央企信用债指数 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 | 0.11% | 0.05% | 0.24% | 0.07% | -0.13% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.22% | 0.04% | 1.42% | 0.05% | -0.20% | -0.01% |
| 过去一年 | 2.96% | 0.03% | 3.48% | 0.04% | -0.52% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.46% | 0.03% | 5.29% | 0.04% | -0.83% | -0.01% |

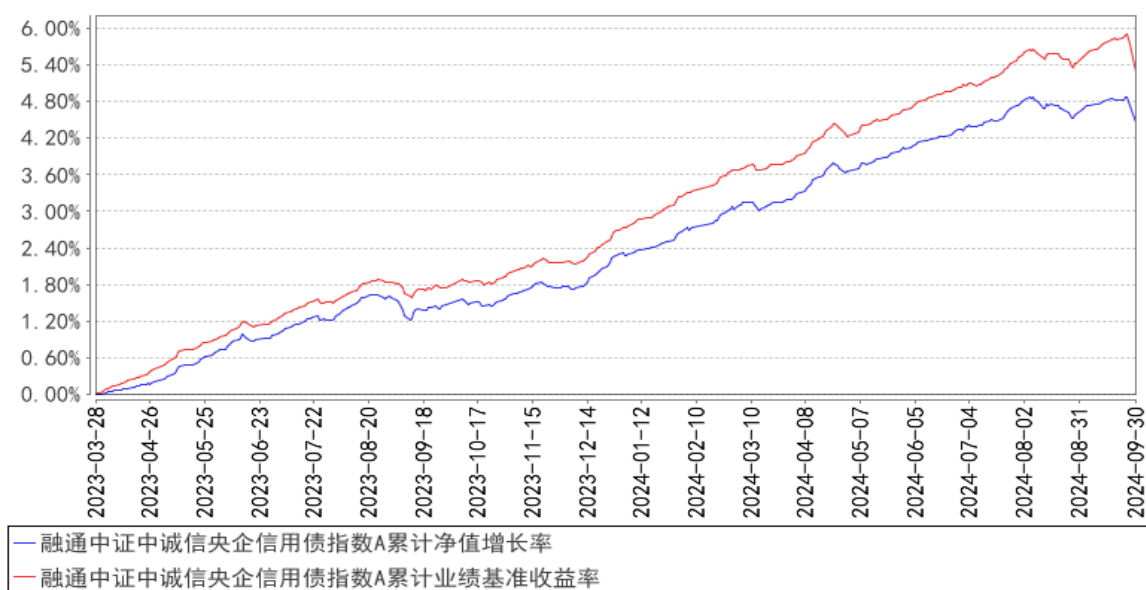
融通中证中诚信央企信用债指数 C

| 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 | 0.18% | 0.05% | 0.24% | 0.07% | -0.06% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.22% | 0.04% | 1.42% | 0.05% | -0.20% | -0.01% |

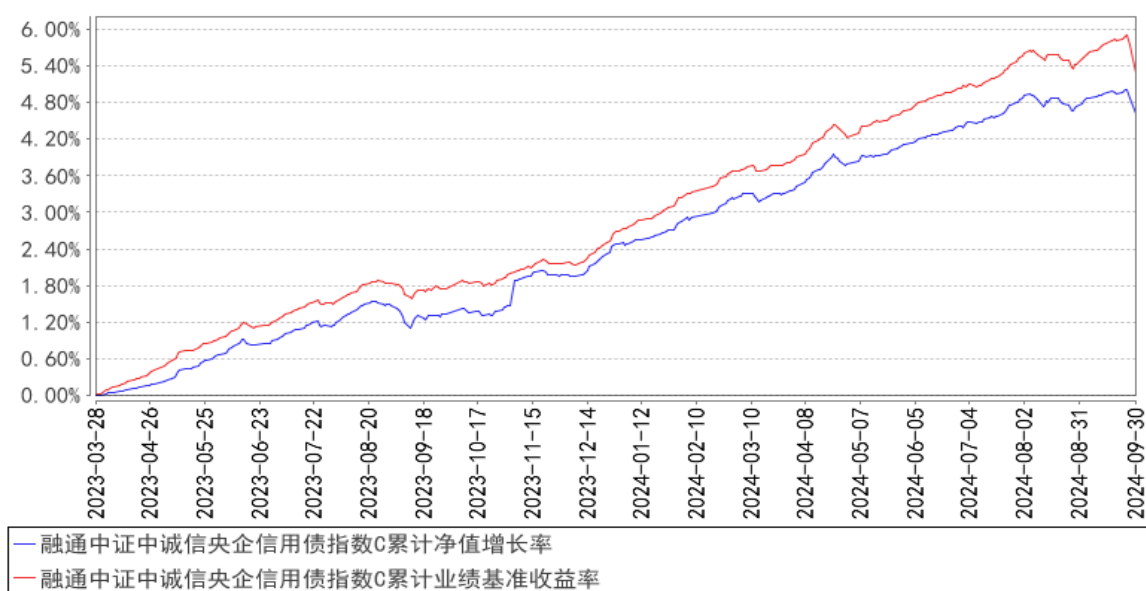
| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去一年 | 3.23% | 0.04% | 3.48% | 0.04% | -0.25% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.61% | 0.04% | 5.29% | 0.04% | -0.68% | 0.00% |

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

融通中证中诚信央企信用债指数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



融通中证中诚信央企信用债指数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



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 | | |
| 王超 | 本基金的基金经理、固定收益投资部总经理 | 2023 年 6 月 6 日 | - | 16 年 | 王超先生，厦门大学金融工程硕士，16 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2007 年 7 月至 2012 年 8 月就职于平安银行金融市场产品部从事债券投资研究工作。2012 年 8 月加入融通基金管理有限公司，历任投资经理、固定收益部总监、融通汇财宝货币市场基金基金经理、融通通源短融债券型证券投资基金基金经理、融通通瑞债券型证券投资基金基金经理、融通增裕债券型证券投资基金基金经理、融通增丰债券型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、融通稳利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、融通通泰保本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、融通增鑫债券型证券投资基金基金经理、融通超短债债券型证券投资基金基金经理、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、融通通优债券型证券投资基金基金经理、融通增强收益债券型证券投资基金基金经理、融通稳健增长一年持有期混合型证券投资基金基金经理、融通收益增强债券型证券投资基金基金经理，现任固定收益投资部总经理、融通债券投资基金基金经理、融通四季添利债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通岁岁添利定期开放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、融通通恒 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通通灿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、融通增强收益债券型证券投资基金基金经理。 |
| 雷冠中 | 本基金的基金经理 | 2024 年 2 月 26 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 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 融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、融通通源短融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、融通通玺债券型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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的交易共 1 次，为指数投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，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

债券市场回顾：2024 年三季度，债券市场先牛后熊，8 月开始出现了明显回调，尤其是信用债表现弱于利率债，利差在经历了上半年极致压缩信用风险溢价和流动性溢价后开始逐步走阔。9 月下旬伴随大类资产轮动和市场风险偏好变化，债券再次出现明显回调且信用债仍然表现较弱，

主要原因是负债端扰动带来的流动性溢价走阔，同时经济基本面的现实尚未表现出显著改善迹象。当前流动性是债券市场面临的主要矛盾，短期内随着大类资产切换部分流动性较弱的债券品种仍然面临利差进一步走阔风险，流动性较好的利率债品种当前逐步呈现配置价值。

基金操作：回顾 2024 年第三季度的基金操作，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，同时适度降低了产品的久期，规避了部分市场调整带来的亏损。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通中证中诚信央企信用债指数 A 基金份额净值为 1.0302 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.11%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%；

截至本报告期末融通中证中诚信央企信用债指数 C 基金份额净值为 1.0461 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.18%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%。

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 | 3,985,285,543.34 | 98.03 |
| | 其中：债券 | 3,975,277,258.41 | 97.78 |
| | 资产支持证券 | 10,008,284.93 | 0.25 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 59,610,209.19 | 1.47 |
| | 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 | 20,484,000.77 | 0.50 |
| 8 | 其他资产 | 60,147.26 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 4,065,439,900.56 | 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 | 838,415,141.83 | 26.27 |
| | 其中：政策性金融债 | 331,424,928.68 | 10.38 |
| 4 | 企业债券 | 355,869,380.82 | 11.15 |
| 5 | 企业短期融资券 | 152,145,137.48 | 4.77 |
| 6 | 中期票据 | 2,436,523,121.57 | 76.33 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 192,324,476.71 | 6.03 |
| 10 | 合计 | 3,975,277,258.41 | 124.54 |

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 | 2228009 | 22 光大银行小微债 | 2,500,000 | 254,876,721.31 | 7.99 |
| 2 | 220214 | 22 国开 14 | 2,500,000 | 250,805,219.78 | 7.86 |
| 3 | 102282150 | 22 国航 MTN001 | 1,600,000 | 160,663,259.18 | 5.03 |
| 4 | 102282267 | 22 国新控股 MTN004(能源保供特别债) | 1,200,000 | 124,912,918.03 | 3.91 |
| 5 | 102380815 | 23 东航 MTN001 | 1,200,000 | 121,909,367.67 | 3.82 |

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 | 263162 | 长兴 16A1 | 100,000 | 10,008,284.93 | 0.31 |

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**

本基金根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，参与国债期货交易。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

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 20 农业银行二级 01，其发行主体为中国农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。

2、本基金投资的前十名证券中的 22 光大银行小微债，其发行主体为中国光大银行股份有限公司。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

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 55,928.07 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,219.19 |
| 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 | 60,147.26 |

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

| 项目 | 融通中证中诚信央企信用债指数 A | 融通中证中诚信央企信用债指数 C |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,714,284,863.97 | 749.20 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,983,568,350.26 | 95.95 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,599,593,521.90 | 211.39 |
| 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 | 3,098,259,692.33 | 633.76 |

§ 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 | 序号 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----|--------------------|------|------|------------|------|
| | | 持有基金份额比例达到或者超过 20% | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 |
| | | | | | | |

| | | 的时间区 间 | | | | | |
|--|---|-----------------------|------------------|----------------|------------------|----------------|-------|
| 机 构 | 1 | 20240701- 20240717 | 1,487,946,632.28 | - | 1,190,357,305.82 | 297,589,326.46 | 9.61 |
| 机 构 | 2 | 20240725- 20240930 | - | 968,991,279.07 | - | 968,991,279.07 | 31.28 |
| 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中证中诚信央企信用债指数证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通中证中诚信央企信用债指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通中证中诚信央企信用债指数证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通中证中诚信央企信用债指数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

2024 年 10 月 25 日