

富国添享一年持有期债券型证券投资基金

二〇二二年第 2 季度报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国银行股份有限公司

送出日期： 2022 年 07 月 21 日

## § 1 重要提示

富国基金管理有限公司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。

基金托管人中国银行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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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	富国添享一年持有期债券	
基金主代码	009290	
基金运作方式	契约型开放式。本基金对每份基金份额设置 1 年的最短持有期限，投资者每笔认购/申购的基金份额需至少持有满一年，在一年持有期内不能提出赎回申请。	
基金合同生效日	2020 年 06 月 02 日	
报告期末基金份额总额（单位：份）	1,646,004,511.07	
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。	
投资策略	本基金在充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性及严格控制风险的前提下，通过分析经济周期变化、货币政策、债券供求等因素，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，制定债券投资策略，挖掘价值被低估的标的券种，力争实现超越业绩基准的投资收益。在债券投资中，本基金主要采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利、利差收益投资、杠杆投资、个券挖掘和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。	
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率*80%+银行一年期定期存款利率(税后)*20%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	富国添享一年持有期债券 A	富国添享一年持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	009290	009291
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	518,993,529.99	1,127,010,981.08

### § 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	富国添享一年持有期债券 A 报告期(2022年04月01日-2022年06月30日)	富国添享一年持有期债券 C 报告期(2022年04月01日-2022年06月30日)
1. 本期已实现收益	2,260,614.44	7,455,816.92
2. 本期利润	3,523,113.97	12,573,053.95
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0142	0.0130
4. 期末基金资产净值	568,876,333.31	1,227,504,899.56
5. 期末基金份额净值	1.0961	1.0892

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

###### (1) 富国添享一年持有期债券 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	1.31%	0.04%	0.92%	0.03%	0.39%	0.01%
过去六个月	1.88%	0.04%	1.61%	0.04%	0.27%	0.00%
过去一年	4.46%	0.07%	4.12%	0.04%	0.34%	0.03%
自基金合同生效起至今	9.61%	0.09%	6.20%	0.05%	3.41%	0.04%

###### (2) 富国添享一年持有期债券 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	1.24%	0.04%	0.92%	0.03%	0.32%	0.01%
过去六个月	1.73%	0.04%	1.61%	0.04%	0.12%	0.00%
过去一年	4.14%	0.07%	4.12%	0.04%	0.02%	0.03%

自基金合同生效起至今	8.92%	0.09%	6.20%	0.05%	2.72%	0.04%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

(1) 自基金合同生效以来富国添享一年持有期债券 A 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



注：1、截止日期为2022年6月30日。

2、本基金于2020年6月2日成立，建仓期6个月，从2020年6月2日起至2020年12月1日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2) 自基金合同生效以来富国添享一年持有期债券 C 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



注：1、截止日期为2022年6月30日。

2、本基金于2020年6月2日成立，建仓期6个月，从2020年6月2日起至2020年12月1日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
武磊	本基金基金经理	2020-06-02	—	11.0	<p>博士，曾任华泰联合证券有限责任公司研究员，华泰证券股份有限公司投资经理，国泰君安证券股份有限公司资本市场部董事，上海国泰君安证券资产管理有限公司投资经理；自2016年12月加入富国基金管理有限公司，历任固定收益基金经理、固定收益投资部固定收益投资总监助理、副总监；现任富国基金固定收益投资部副总经理兼固定收益基金经理。2017年3月起任富国产业债债券型证券投资基金基金经理，2017年3月至2019年11月任富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理，2017年6月起任富国鼎利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（原富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金，于2019年7月9日更名）基金经理，2017年7月起任富</p>

				<p>国泓利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年4月起任富国臻利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年5月起任富国尊利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；</p> <p>2018年7月至2019年11月任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理，2018年7月起任富国新天锋债券型证券投资基金（LOF）（原富国新天锋定期开放债券型证券投资基金，于2019年2月20日更名）基金经理；2018年9月起任富国中债-1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2019年3月至2020年10月任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理；2019年4月起任富国中债1-5年农发行债券指数证券投资基金基金经理；</p> <p>2020年3月起任富国泽利纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年6月起任富国添享一年持有期债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。</p>
--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。 2、证券从业的涵义



遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## **4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明**

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国添享一年持有期债券型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国添享一年持有期债券型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

## **4.3 公平交易专项说明**

### **4.3.1 公平交易制度的执行情况**

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以

及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

#### **4.3.2 异常交易行为的专项说明**

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现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**

2022 年二季度，国内疫情反弹给二季度经济带来负面冲击，对 4、5 月份经济数据产生明显拖累。稳增长政策力度加大，货币政策继续发力，流动性保持宽裕，专项债发行也明显加速。总体上，经济受到冲击后在政策呵护下开始逐步复苏，政策依然偏宽松，收益率曲线陡峭化变动，长端偏震荡，中短端下行较明显。权益市场在 4 月份波动较大，随后走出反弹行情，转债市场也跟随表现。本基金在二季度控制组合久期杠杆，逐步提高转债仓位，适度把握了转债反弹行情机会，报告期净值有所增长。

#### **4.5 报告期内基金的业绩表现**

本报告期，本基金份额净值增长率 A 级为 1.31%，C 级为 1.24%，同期业绩比较基准收益率 A 级为 0.92%，C 级为 0.92%

#### **4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

## § 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	固定收益投资	1,706,332,655.03	94.17
	其中：债券	1,666,548,578.76	91.97
	资产支持证券	39,784,076.27	2.20
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	71,006,209.16	3.92
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	19,265,479.64	1.06
7	其他资产	15,419,723.33	0.85
8	合计	1,812,024,067.16	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

注：本基金本报告期末未持有境内股票资产。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

### 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	17,469,004.66	0.97
2	央行票据	—	—
3	金融债券	446,272,632.42	24.84
	其中：政策性金融债	91,896,334.26	5.12
4	企业债券	416,269,947.36	23.17
5	企业短期融资券	338,092,633.54	18.82
6	中期票据	229,423,762.74	12.77
7	可转债（可交换债）	120,642,851.19	6.72

8	同业存单	98,377,746.85	5.48
9	其他	—	—
10	合计	1,666,548,578.76	92.77

### 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	042100441	21 电网 CP012	700,000	71,305,517.26	3.97
2	1728022	17 工商银行二级 02	600,000	62,127,304.11	3.46
3	1828002	18 农业银行二级 01	500,000	51,206,986.30	2.85
4	220201	22 国开 01	500,000	50,528,849.32	2.81
5	112205055	22 建设银行 CD055	500,000	49,114,352.05	2.73

### 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	183994	微业 2 优 A	100,000	10,008,898.63	0.56
2	169628	益辰 01A1	80,000	8,290,880.00	0.46
3	169084	健弘 06A	80,000	8,250,634.08	0.46
4	169118	长治 01A	80,000	8,229,751.23	0.46
5	180112	京诚陆 7A	50,000	5,003,912.33	0.28

### 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投资。

### 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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

## **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**

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

### **5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：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 申明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。**

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，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人民银行、中国银行保险监督管理委员会、国家外汇管理局上海市分局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海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上海监管局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设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、中国人民银行的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业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。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余证券的发行主体本期未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 申明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。

本基金本报告期末未持有股票资产。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	77,149.51
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	15,342,573.82
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	15,419,723.33

#### 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	110059	浦发转债	8,479,901.37	0.47
2	127016	鲁泰转债	5,856,590.69	0.33
3	113623	凤21转债	5,779,697.12	0.32
4	127047	帝欧转债	4,258,238.40	0.24
5	110053	苏银转债	3,779,384.38	0.21
6	110080	东湖转债	3,548,930.14	0.20

7	123049	维尔转债	3,488,696.92	0.19
8	113052	兴业转债	3,350,146.03	0.19
9	123121	帝尔转债	2,953,986.30	0.16
10	127030	盛虹转债	2,363,678.22	0.13
11	110043	无锡转债	2,358,261.92	0.13
12	127025	冀东转债	2,307,453.02	0.13
13	110067	华安转债	2,203,119.45	0.12
14	123120	隆华转债	2,068,268.63	0.12
15	128083	新北转债	1,954,508.22	0.11
16	113050	南银转债	1,774,011.04	0.10
17	127043	川恒转债	1,739,431.78	0.10
18	128135	洽洽转债	1,573,169.50	0.09
19	110075	南航转债	1,398,370.68	0.08
20	113545	金能转债	1,392,265.85	0.08
21	128127	文科转债	1,292,356.72	0.07
22	127040	国泰转债	1,289,973.70	0.07
23	113044	大秦转债	1,286,885.37	0.07
24	113635	升 21 转债	1,279,734.79	0.07
25	123100	朗科转债	1,262,867.40	0.07
26	128087	孚日转债	1,257,395.89	0.07
27	128121	宏川转债	1,250,389.59	0.07
28	113602	景 20 转债	1,217,451.00	0.07
29	110057	现代转债	1,208,891.78	0.07
30	123132	回盛转债	1,186,243.21	0.07
31	113609	永安转债	1,173,780.00	0.07
32	113610	灵康转债	1,159,152.60	0.06
33	128035	大族转债	1,128,184.93	0.06
34	127024	盈峰转债	1,077,919.18	0.06
35	113606	荣泰转债	1,070,052.09	0.06
36	113048	晶科转债	766,773.70	0.04
37	127021	特发转 2	745,316.71	0.04
38	128144	利民转债	715,942.19	0.04

39	123082	北陆转债	619,309.61	0.03
40	113011	光大转债	531,673.29	0.03
41	123116	万兴转债	420,855.02	0.02
42	110083	苏租转债	363,155.10	0.02
43	132022	20广版EB	209,027.18	0.01
44	113636	甬金转债	121,309.66	0.01

#### 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。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。



## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富国添享一年持有期债券 A	富国添享一年持有期债券 C
报告期期初基金份额总额	144,849,616.04	505,762,936.46
报告期期间基金总申购份额	379,198,077.95	621,889,435.42
减：报告期期间基金总赎回份额	5,054,164.00	641,390.80
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	518,993,529.99	1,127,010,981.08

## § 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	—
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	—
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	—

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

## § 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：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国添享一年持有期债券型证券投资基金的文件
- 2、富国添享一年持有期债券型证券投资基金基金合同
- 3、富国添享一年持有期债券型证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、富国添享一年持有期债券型证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

### 9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。  
咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址：  
<http://www.fullgoal.com.cn>。

富国基金管理有限公司  
2022 年 07 月 21 日