

富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

二〇二四年第2季度报告

2024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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2024年07月19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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 17 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 2024 年 4 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式   |
| 基金主代码      | 006750  |
| 交易代码       | 006750  |
| 基金运作方式     | 契约型，定期开放式   |
| 基金合同生效日    | 2019年03月07日   |
| 报告期末基金份额总额 | 966,134,057.06份   |
| 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       | 在封闭期内，本基金奉行“自上而下”和“自下而上”相结合的主动式投资管理理念，采用价值分析方法，在分析和判断财政、货币、利率、通货膨胀等宏观经济运行指标的基础上，自上而下确定和动态调整大类资产比例和债券的组合目标久期、期限结构配置及类属配置；同时，采用“自下而上”的投资理念，在研究分析信用风险、流动性风险、供求关系、收益率水平、税收水平等因素基础上，自下而上的精选个券，把握固定收益类金融工具投资机会。在债券投资策略的基础上，本基金还将根据债券市场的动态变化，采取多种灵活的策略，获取超额收益，主要包括骑乘收益率曲线策略、息差策略等。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。 |
| 业绩比较基准     | 中债综合财富（总值）指数收益率×90%+1年期定期存款利率（税后）×10%   |
| 风险收益特征     | 本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。   |
| 基金管理人      | 富国基金管理有限公司  |
| 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（2024年04月01日-<br>2024年06月30日） |
|-----------------|----------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 8,453,849.90                     |
| 2. 本期利润         | 10,890,089.20                    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0113                           |
| 4. 期末基金资产净值     | 1,003,973,327.39                 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0392                           |

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 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      | 1.10%  | 0.04%     | 1.60%      | 0.06%         | -0.50% | -0.02% |
| 过去六个月      | 2.17%  | 0.04%     | 3.46%      | 0.06%         | -1.29% | -0.02% |
| 过去一年       | 3.59%  | 0.04%     | 5.48%      | 0.05%         | -1.89% | -0.01% |
| 过去三年       | 10.06% | 0.05%     | 14.42%     | 0.05%         | -4.36% | 0.00%  |
| 过去五年       | 15.83% | 0.04%     | 23.04%     | 0.06%         | -7.21% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.25% | 0.04%     | 24.26%     | 0.06%         | -7.01% | -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



注：1、截止日期为 2024 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2019 年 3 月 7 日成立，建仓期 6 个月，从 2019 年 3 月 7 日起至 2019 年 9 月 6 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 |        |  |
| 刘瀚驰 | 本基金现任基金经理 | 2021-04-21  | —    | 9      | 硕士，曾任职于招商银行总行资产管理部、招银理财有限责任公司；自2020年6月加入富国基金管理有限公司，历任固定收益基金经理助理、固定收益基金经理；现任富国基金固定收益投资部固定收益基金经理。自2020年11月起任富国聚利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金(原富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金)基金经理；自2021年04月起任富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自2021年11月起任富国达利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自2022年06月起任富国碳中和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。 |
| 吕春杰 | 本基金现      | 2021-08-12  | —    | 16     | 硕士，曾任国泰君安证券股份  |

|  |           |  |  |   |
|--|-----------|--|--|---|
|  | 任基金经<br>理 |  |  | <p>有限公司研究员/董事，中国人保资产股份有限公司高级投资经理，上海证券有限责任公司资产管理总部副总经理；自2021年6月加入富国基金管理有限公司，现任富国基金固定收益投资部副总经理，兼任富国基金固定收益基金经理。自2021年08月起任富国长江经济带纯债债券型证券投资基金基金经理；自2021年08月起任富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自2021年11月起任富国颐利纯债债券型证券投资基金基金经理；自2021年12月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；自2021年12月起任富国信用债债券型证券投资基金基金经理；自2022年06月起任富国碳中和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；自2022年07月起任富国汇享三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；自2022年09月起任富国久利稳健配置混合型证券投资基金基金经理；自2022年10月起任富国汇泽</p> |
|--|-----------|--|--|---|

|  |  |  |  |  |                               |
|--|--|--|--|--|-------------------------------|
|  |  |  |  |  | 一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------|

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中国证监会《证券投资基金经营机构董事、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遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式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》、《富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式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**

2024 年二季度，国内经济延续平稳修复态势，但同时也面临有效需求不足、外部环境复杂严峻性等挑战。5-6 月制造业 PMI 指数重新回落到 50 以下，CPI 和 PPI 同比仍处低位。二季度超长期特别国债逐步发行，流动性保持合理充裕，4 月市场利率定价自律机制规范手工补息行为，5 月央行取消个人住房贷款利率政策下限，引导社会融资成本继续下降。二季度债券市场震荡偏强，4 月底利率有所调整，但 5-6 月重新下行。投资操作上，本基金适时调整久期和杠杆，报告期内净值有所增长。

#### **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为 1.10%，同期业绩比较基准收益率为 1.60%。

#### **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            | 1,075,523,907.09 | 99.62        |
|    | 其中：债券             | 1,075,523,907.09 | 99.62        |
|    | 资产支持证券            | —                | —            |
| 3  | 贵金属投资             | —                | —            |
| 4  | 金融衍生品投资           | —                | —            |
| 5  | 买入返售金融资产          | —                | —            |
|    | 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      | 4,045,051.21     | 0.37         |
| 7  | 其他资产              | 28,244.28        | 0.00         |
| 8  | 合计                | 1,079,597,202.58 | 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      | 10,227,035.33  | 1.02         |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | 741,077,495.86 | 73.81        |
|    | 其中：政策性金融债 | 379,829,545.39 | 37.83        |
| 4  | 企业债券      | 41,551,123.29  | 4.14         |
| 5  | 企业短期融资券   | —              | —            |
| 6  | 中期票据      | 134,314,796.44 | 13.38        |

|    |           |                  |        |
|----|-----------|------------------|--------|
| 7  | 可转债（可交换债） | —                | —      |
| 8  | 同业存单      | 148,353,456.17   | 14.78  |
| 9  | 其他        | —                | —      |
| 10 | 合计        | 1,075,523,907.09 | 107.13 |

### 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  | 112402001 | 24 工商银行 CD001 | 1,000,000 | 99,021,411.48 | 9.86         |
| 2  | 190208    | 19 国开 08      | 800,000   | 82,752,524.59 | 8.24         |
| 3  | 230404    | 23 农发 04      | 700,000   | 71,566,158.90 | 7.13         |
| 4  | 240252    | 23 平证 15      | 600,000   | 62,061,452.05 | 6.18         |
| 5  | 102381943 | 23 粤海 MTN001  | 500,000   | 51,816,704.92 | 5.16         |

### 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，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

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。

股票不属于本基金的投资范围，故本项不适用。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 28,244.28 |
| 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    | 28,244.28 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

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

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 966,134,057.06 |
| 报告期期间基金总申购份额              | —              |
| 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               | 966,134,057.06 |

## § 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         | 10,000,000.00 |
| 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         | 10,000,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 1.04          |

注：买入/申购含红利再投资、转换入份额；卖出/赎回含转换出份额。

### 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 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<br>(份) | 持有份额<br>占基金总<br>份额比例<br>(%) | 发起份额总数<br>(份) | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例 (%) | 发起份额<br>承诺持有<br>期限 |
|-------------|---------------|-----------------------------|---------------|--------------------------|--------------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,000.00 | 1.04                        | 10,000,000.00 | 1.04                     | 3年                 |
| 基金管理人高级管理人员 | —             | —                           | —             | —                        | 0                  |
| 基金经理等人员     | —             | —                           | —             | —                        | 0                  |
| 基金管理人股东     | —             | —                           | —             | —                        | 0                  |
| 其他          | —             | —                           | —             | —                        | 0                  |
| 合计          | 10,000,000.00 | 1.04                        | 10,000,000.00 | 1.04                     | 3年                 |



## § 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   |
| 机构   | 1              | 2024-04-01 至 2024-06-30 | 956,133,856.42 | —    | —    | 956,133,856.42 | 98.96% |
| 产品特有风险   |                |                         |                |      |      |                |        |
| <p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p> |                |                         |                |      |      |                |        |

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的文件
- 2、富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 3、富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式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、富国德利纯债三个月定期开放债券型发起式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

### 10.2 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

### 10.3 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  
2024 年 07 月 19 日