融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 26 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 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 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通通跃一年定开债券发起式
基金主代码	012732
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 27 日
报告期末基金份额总额	10,130,974.29 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。封闭期投资策略主要包括资产配置策略、利率策略、信用策略、类属配置与个券选择策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略。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	中债综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§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（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）

1.本期已实现收益	140,994.99
2.本期利润	131,235.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0130
4.期末基金资产净值	10,858,182.81
5.期末基金份额净值	1.0718

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。

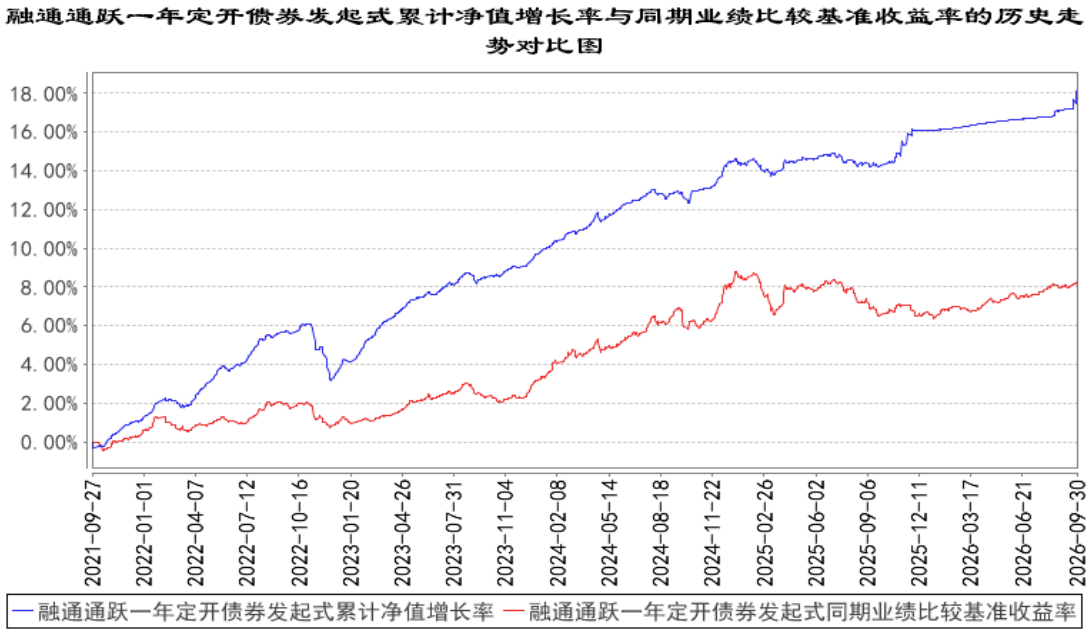
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	1.23%	0.10%	0.52%	0.03%	0.71%	0.07%
过去六个月	1.48%	0.07%	1.15%	0.03%	0.33%	0.04%
过去一年	3.37%	0.08%	1.48%	0.04%	1.89%	0.04%
过去三年	8.87%	0.06%	5.66%	0.07%	3.21%	-0.01%
过去五年	18.47%	0.06%	8.15%	0.07%	10.32%	-0.01%
自基金合同生效起至今	18.13%	0.06%	8.12%	0.07%	10.01%	-0.01%

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



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		
刘舒乐	本基金的基金经理	2023 年 7 月 12 日	-	10 年	刘舒乐女士，清华大学金融硕士，10 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2016 年 7 月加入融通基金管理有限公司，历任投资经理、融通增鑫债券型证券投资基金基金经理、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通增享纯债债券型证券投资基金基金经理、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、融通新机遇灵活配置混合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、融通通慧混合型证券投资基金基金经理。
杨龙龙	本基金的基金经理	2026 年 9 月 8 日	-	11 年	杨龙龙先生，金融硕士，11 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2015 年 7 月至 2025 年 7 月就职于中信建投基金管理有限公司，历任投资经理助理、投资经理、基金经理。2025 年 7 月加入融通基金管理有限公司，现任融通通

					源短融债券型证券投资基金基金经理、融通通祺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、融通稳鑫 90 天持有期债券型证券投资基金基金经理、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。
雷冠中	本基金的基金经理	2026 年 9 月 8 日	-	9 年	雷冠中先生，经济学硕士，9 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。历任融通增益债券型证券投资基金基金经理、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，现任融通通安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、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。

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、基金业务相关工作的时间为计算标准。

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遵规守信情况的说明

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

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

债券市场在三季度继续走强，上涨过程虽然有所波动但是上涨趋势未变。中短信用债和超长端利率债收益率也有较为明显的下行。三季度市场继续走强的主要原因在于经济基本面边际承压的大背景下，央行货币政策维持了相对宽松的格局，对债市行情起到一定的支撑作用。经济数据持续下行，实体信贷需求疲弱，是利率下行的根本原因。另一方面是在于以银行理财为代表的的非银机构负债端在三季度持续净流入，对债券需求，尤其是偏中短端信用债的需求较为旺盛，导致了信用利差的持续压缩。货币政策方面，央行推出隔夜逆回购，跨月和跨季资金面波动逐步减小，对债市也形成了明显利好支撑。本基金基于对基本面和资金面的综合研判，在三季度策略选择上以利率债作为主要配置品种，组合持仓偏哑铃型，通过长端和超长端利率债的交易性机会的捕捉来提高组合收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0718 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.23%，业绩比较基准收益率为 0.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本报告期末，本基金存在连续六十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

自 2026 年 7 月 1 日至 2026 年 9 月 30 日，基金管理人自主承担本基金项下相关固定费用。

§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	10,539,024.25	51.85
	其中：债券	10,539,024.25	51.85
	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	9,787,901.04	48.15
8	其他资产	-	-
9	合计	20,326,925.29	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	1,515,375.21	13.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,023,649.04	83.10
	其中：政策性金融债	9,023,649.04	83.10
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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,539,024.25	97.06

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	260306	26 进出 06	90,000	9,023,649.04	83.10
2	019839	26 国债 10	15,000	1,515,375.21	13.96

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

无。

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

本基金的国债期货投资以风险管理为原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。基金管理人按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

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 26 进出 06，其发行主体为中国进出口银行。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，受到国家外汇管理局北京市分局的处罚。

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约定的备选股票库

无。

5.10.3 其他资产构成

无。

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

报告期期初基金份额总额	10,130,974.29
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	10,130,974.29

§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	10,128,706.75
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	10,128,706.75
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	99.98

注：申购份额包括红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额、因份额合并而减少的份额。

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	10,128,706.75	99.98	10,002,361.10	98.73	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-

其他	2,054.14	0.02	2,003.11	0.02	不少于三年
合计	10,130,760.89	100.00	10,004,364.21	98.75	-

注：本基金合同生效日为 2021 年 9 月 27 日，本基金发起份额持有期限自合同生效日起不少于三年。

§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	20260701-20260930	10,128,706.75	-	-	10,128,706.75	99.98
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。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

2026 年 7 月 30 日，本基金管理人发布《关于融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，本次大会的权益登记日为 2026 年 7 月 2 日，大会投票表决时间自 2026 年 7 月 3 日起至 2026 年 7 月 28 日 17:00 止（投票表决时间以本基金管理人收到表决票时间为准），审议《关于融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金持续运作的议案》 。根据计票结果，参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额未达到权益登记日基金总份额的 50%（含 50%），因此未达到《基金合同》约定的关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的有效条件。

2026 年 9 月 29 日，本基金管理人发布了《关于以通讯方式召开融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金调整销售对象、管理费率、托管费率、基金份额类别设置、申赎费率、估值方法等事项并修订基金合同等法律文件的议案》。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件

（二）《融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》

（三）《融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》

（四）《融通通跃一年定期开放债券型发起式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

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，或登录本基金管理人网站 http://www.rtfund.com 查阅。

融通基金管理有限公司

2026 年 10 月 26 日