

# 财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金

2019年第1季度报告

2019年03月31日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:宁波银行股份有限公司

报告送出日期:2019年04月22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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4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。

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。

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《财通资管鑫达回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，财通资管鑫达回报混合型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自2018年12月4日起至2018年12月28日17:00止。本次大会审议了《关于财通资管鑫达回报混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，本次会议议案于2019年1月2日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。根据决议内容，财通资管鑫达回报混合型证券投资基金自2019年1月3日起变更注册为财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金，自该日起，修订后的《财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，原《财通资管鑫达回报混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金基金合同》等相关规定进行运作。就前述修改变更事项，具体可查阅本基金管理人于2019年1月3日披露的《财通证券资产管理有限公司关于财通资管鑫达回报混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原财通资管鑫达回报混合型证券投资基金报告期自2019年1月1日至2019年1月2日止，财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金报告期自2019年1月3日至2019年3月31日止。

## § 2 基金产品概况

### 转型后

基金简称	财通资管鸿达债券
基金主代码	005307
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年01月03日

报告期末基金份额总额	116,052,907.47份		
投资目标	在严格控制风险的基础上，把握市场机会，追求基金资产的稳健增值。		
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的投研能力，采取自上而下的方法对基金的大类资产进行动态配置，综合久期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选，力争在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定超额收益。		
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率		
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上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。		
基金管理人	财通证券资产管理有限公司		
基金托管人	宁波银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	财通资管鸿达 债券A	财通资管鸿达 债券C	财通资管鸿达 债券E
下属分级基金的交易代码	005307	005308	005882
报告期末下属分级基金的份额总额	5,479,379.01 份	104,374,816.4 7份	6,198,711.99 份

### 转型前

基金简称	财通资管鑫达混合
基金主代码	005307
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年01月24日
报告期末基金份额总额	9,737,195.86份
投资目标	在严格控制风险的基础上，把握市场机会，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的投研能力，采取自上而下的方法对基金的大类资产进行动态配置，综合久期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选，力争在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定超额收益。另外，本基金可投资于股票、权证等权益类资产，基金管理人将选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资，强

	化基金的获利能力，提高预期收益水平，以期达到收益增强的效果。		
业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%		
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。		
基金管理人	财通证券资产管理有限公司		
基金托管人	宁波银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	财通资管鑫达混合A	财通资管鑫达混合C	财通资管鑫达混合E
下属分级基金的交易代码	005307	005308	005882
报告期末下属分级基金的份额总额	893,313.42份	2,842,211.65份	6,001,670.79份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

##### 财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年01月03日(基金合同生效日)-2019年03月31日)		
	财通资管鸿达债券A	财通资管鸿达债券C	财通资管鸿达债券E
1. 本期已实现收益	33,370.86	200,290.12	52,412.59
2. 本期利润	34,838.09	247,855.06	60,536.97
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0087	0.0098	0.0107
4. 期末基金资产净值	5,654,000.50	107,236,955.65	6,330,098.84
5. 期末基金份额净值	1.0319	1.0274	1.0212

注：1、所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指本期基金利息收入、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、财通资管鑫达回报混合型证券投资基金自2019年1月3日起转型为财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金。

财通资管鑫达回报混合型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年01月01日 - 2019年01月02日)		
	财通资管鑫达混合A	财通资管鑫达混合C	财通资管鑫达混合E
1. 本期已实现收益	113.62	328.73	722.91
2. 本期利润	229.62	696.53	1,494.51
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0003	0.0002	0.0002
4. 期末基金资产净值	912,293.46	2,892,423.04	6,068,051.52
5. 期末基金份额净值	1.0212	1.0177	1.0111

注：1、所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指本期基金利息收入、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、财通资管鑫达回报混合型证券投资基金自2019年1月3日起转型为财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金。

3.2 基金净值表现

3.2.1 财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金

（报告期：2019年1月3日-2019年3月31日）

3.2.1.1 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

财通资管鸿达债券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
自基金转型之日起至2019年3月31日	1.05%	0.04%	0.31%	0.05%	0.74%	-0.01%

财通资管鸿达债券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
自基金转型之日起至2019年3月31日	0.95%	0.03%	0.31%	0.05%	0.64%	-0.02%

### 财通资管鸿达债券E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
自基金转型之日起至2019年3月31日	1.00%	0.03%	0.31%	0.05%	0.69%	-0.02%

### 3.2.1.2 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

财通资管鸿达纯债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



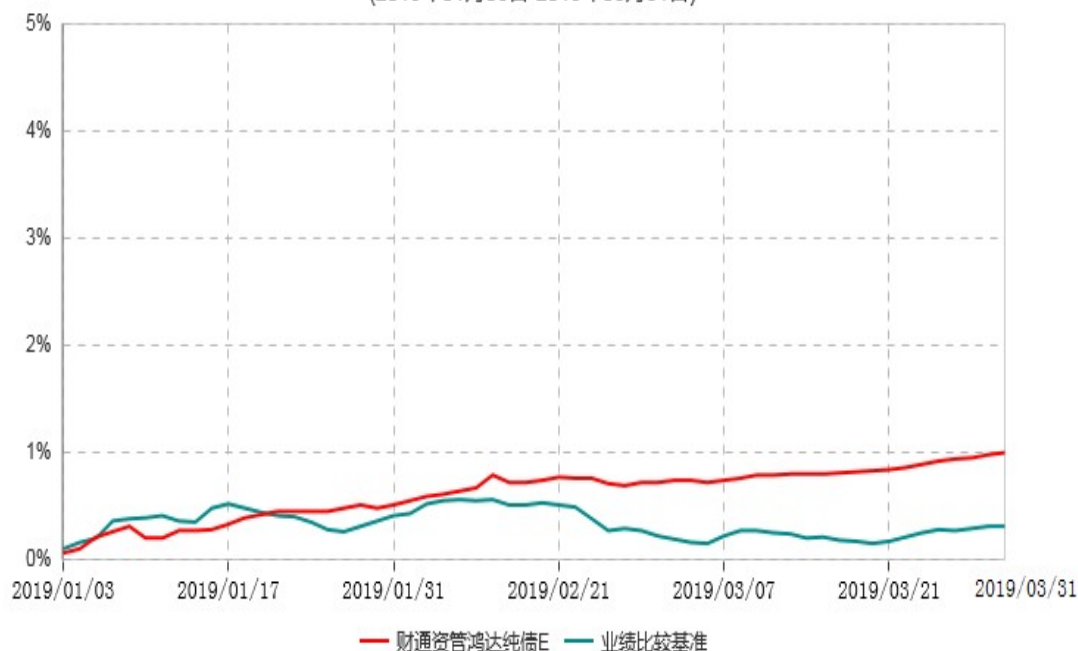
财通资管鸿达纯债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年01月03日-2019年03月31日)



财通资管鸿达纯债E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年01月03日-2019年03月31日)



- 注：1、本基金转型后业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率；  
 2、本基金转型日期为 2019 年 1 月 3 日，截止报告期末本基金转型后基金合同生效未  
 满一年。  
 3、按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组  
 合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

### 3.2.2 财通资管鑫达回报混合型证券投资基金

（报告期：2019年1月1日-2019年1月2日）

### 3.2.2.1 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

#### 财通资管鑫达混合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
自2019年1月1日至2019年1月2日	0.02%	0.00	-0.14%	0.00	0.16%	0.00

#### 财通资管鑫达混合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
自2019年1月1日至2019年1月2日	0.03%	0.00	-0.14%	0.00	0.17%	0.00

#### 财通资管鑫达混合E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
自2019年1月1日至2019年1月2日	0.03%	0.00	-0.14%	0.00	0.17%	0.00

### 3.2.2.2 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



财通资管鑫达混合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

(2018年01月24日-2019年01月02日)



财通资管鑫达混合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

(2018年01月24日-2019年01月02日)



财通资管鑫达混合E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年07月04日-2019年01月02日)



注：1、本基金转型前业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%

2、自2019年1月3日起财通资管鑫达回报混合型证券投资基金转型为财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金。

## § 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		
宫志芳	本基金基金经理、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管鑫管家货币市	2018-01-24	-	8	武汉大学数理金融硕士，中级经济师，2010年7月进入浙江泰隆银行资金运营部先后从事外汇交易和债券交易。2012年3月进入宁波通商银行金融市场部筹备债券业务，主要负责资金、债券投资交易，同时15年初筹备并开展贵金属自营业业务；2016年3月加入财通证券资产管理有限公司。

	场基金、 财通资管 鑫逸回报 混合型证 券投资基 金和财通 资管鑫锐 回报混合 型证券投 资基金基 金经理				
--	---	--	--	--	--

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，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《证券从业人员资格管理办法》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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等规定。

##### 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，本基金与本公司管理的其他基金在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

##### 1. 一季度宏观基本面

2月份CPI同比增长1.50%，较上月低0.20个百分点，暂时处于低位，但未来猪价同比增速料加速上行，考虑到猪价上行周期中同比的结构特征，增速高点可能出现在5月附近，区间30%–50%。2月PPI与上月持平，同比0.10%，3月份PMI数据50.50，超出市场预期49.60，创近半年来新高，站上荣枯线。

2月末，M2同比增长8.00%，增速环比下降0.40个百分点，同比下降0.80个百分点，2月人民币贷款增加8858亿，同比多增465亿，2月社融增量为7030亿，比去年同期少4847亿，同比增速下滑至10.10%。

2月规模以上工业增加值同比增长3.36%，较上月减少3.44个百分点，利润总额累计同比下降14.00%，较上月下降24.30个百分点，企业整体盈利能力有所放缓。

2月中国出口商品总额同比减少20.80%，增速较上月下降30.10个百分点；进口商品总额同比减少5.20%，增速较上月下降4.60个百分点。2月实现贸易顺差40.81亿美元，较上月减少357.13亿美元。目前贸易摩擦对出口的影响有所体现，数据同比环比均出现大幅度的下滑。

1–2月份社会消费品零售总额累计增长8.20%，增速较去年同期放缓1.5个百分点。1–2月份，全国固定资产投资完成额累计值同比增长6.10%，增速较去年同期下降1.80个百分点，较去年12月份回升0.20个百分点，1–2月份基建投资同比增长2.50%，较去年12月份回升0.70个百分点，自去年9月份以来连续回升，制造业投资1–2月份同比增长5.90%，较去年12月份回落3.60个百分点。1–2月份房地产投资大幅回升2.1个百分点至11.60%，主要得益于施工面积增速回升对建安投资的支持，但更为领先的土地购置、商品房销售、新开工面积等地产相关指标，均较前期明显回落。

## 2. 一季度货币政策和监管政策

2月21日，美联储发布了1月FOMC会议纪要。会议纪要有两个关键点，一是纪要显示美联储官员对美国经济增长面临的风险表现出更大的担忧，促使他们发出停止加息的信号；二是纪要显示几乎所有美联储官员希望在今年晚些时候停止缩表。3月21日，美联储公布3月利率决议，维持利率不变，并将今年加息次数的预期缩减至零，此外还表示将在9月份结束央行资产负债表的缩减。信号偏鸽，超出市场预期，利好全球风险资产。

1月下调金融机构存款准备金率，调整普惠金融定向降准考核标准，完成普惠金融定向降准动态考核。一是下调金融机构存款准备金率1个百分点，分两次实施，并对金融机构2019年第一季度到期的中期借贷便利不再续做，释放长期资金约3000多亿元。二是自2019年起将普惠金融定向降准小型和微型企业贷款考核标准由“单户授信小于500万元”调整为“单户授信小于1000万元”，有利于扩大普惠金融定向降准优惠政策的覆盖面，使更多的小微企业受益。三是完成2018年度普惠金融定向降准动态考核，在政策激励下，与上年相比，更多金融机构达到普惠金融定向降准标准，净释放长期资金约2500亿元。这次降准置换中期借贷便利，加上普惠金融定向降准动态考核和1月开展的2575亿元定向中期借贷便利操作，共释放长期资金约8000亿。

## 3. 本季度操作

1月3日本基金变更基金合同为纯债基金，按照中短债的策略进行操作。随客户陆续申购，本季度规模逐步增大，操作方面以配置为主，主要以久期1y或1y内的AAA、AA+城投和AAA龙头产业债为主，杠杆维持低位。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2019年1月2日，财通资管鑫达混合A基金份额净值为1.0212元；自2019年1月1日至2019年1月2日本基金份额净值增长率为0.02%，同期业绩比较基准收益率为-0.14%。

截至2019年1月2日，财通资管鑫达混合C基金份额净值为1.0177元；自2019年1月1日至2019年1月2日本基金份额净值增长率为0.03%，同期业绩比较基准收益率为-0.14%。

截至2019年1月2日，财通资管鑫达混合E基金份额净值为1.0111元；自2019年1月1日至2019年1月2日本基金份额净值增长率为0.03%，同期业绩比较基准收益率为-0.14%。

截至2019年3月31日，财通资管鸿达纯债A基金份额净值为1.0319元；自2019年1月3日至2019年3月31日本基金份额净值增长率为1.05%，同期业绩比较基准收益率为0.31%。

截至2019年3月31日，财通资管鸿达纯债C基金份额净值为1.0274元；自2019年1月3日至2019年3月31日本基金份额净值增长率为0.95%，同期业绩比较基准收益率为0.31%。

截至2019年3月31日，财通资管鸿达纯债E基金份额净值为1.0212元；自2019年1月3日至2019年3月31日本基金份额净值增长率为1.00%，同期业绩比较基准收益率为0.31%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金自2019年1月2日起至3月13日出现基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万的情形，本报告期末本基金已不存在基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金

（报告期：2019年1月3日-2019年3月31日）

##### 5.1.1 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	119,172,926.59	94.54
	其中：债券	119,172,926.59	94.54

	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	686,229.09	0.54
8	其他资产	6,194,464.44	4.91
9	合计	126,053,620.12	100.00

### 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 5.1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 5.1.3 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.1.4 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	6,489,562.00	5.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,613,201.30	8.90
	其中：政策性金融债	10,613,201.30	8.90
4	企业债券	45,998,486.20	38.58
5	企业短期融资券	50,025,500.00	41.96
6	中期票据	5,181,000.00	4.35
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	865,177.09	0.73
10	合计	119,172,926.59	99.96

### 5.1.5 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	108602	国开1704	74,010	7,505,058.06	6.30
2	1480113	14临开债	100,000	6,304,000.00	5.29
3	1480192	14宁国债	100,000	6,296,000.00	5.28
4	019611	19国债01	62,000	6,197,520.00	5.20
5	041900099	19陕煤化CP001	60,000	6,004,200.00	5.04

### 5.1.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.1.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.1.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期内未交易股指期货。

### 5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内未交易国债期货。

### 5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.1.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,898.64
2	应收证券清算款	1,898,462.46

3	应收股利	-
4	应收利息	2,099,315.70
5	应收申购款	2,194,787.64
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,194,464.44

#### 5.1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.2 财通资管鑫达回报混合型证券投资基金

(报告期：2019年1月1日-2019年1月2日)

#### 5.2.1 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	8,987,994.90	88.94
	其中：债券	8,987,994.90	88.94
	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	400,000.00	3.96
	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	410,234.21	4.06
8	其他资产	307,685.03	3.04
9	合计	10,105,914.14	100.00



## 5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

## 5.2.3 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 5.2.4 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	291,933.80	2.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,812,040.00	18.35
	其中：政策性金融债	1,812,040.00	18.35
4	企业债券	6,884,021.10	69.73
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	8,987,994.90	91.04

## 5.2.5 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	108602	国开1704	12,000	1,211,640.00	12.27
2	1680099	16宏升小微债	5,000	503,850.00	5.10
3	143103	17云投G1	5,010	502,853.70	5.09
4	108901	农发1801	5,000	500,050.00	5.06
5	1680360	16威海临港小微债	5,000	498,850.00	5.05

**5.2.6 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**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**5.2.7 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**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**5.2.8 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**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金报告期内未交易股指期货。

**5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金报告期内未交易国债期货。

**5.2.11 投资组合报告附注**

**5.2.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。**

**5.2.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。**

**5.2.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,920.28
2	应收证券清算款	101,169.74
3	应收股利	-
4	应收利息	202,596.21
5	应收申购款	998.80
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	307,685.03

**5.2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

### 6.1 财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金

(报告期：2019年1月3日-2019年3月31日)

单位：份

	财通资管鸿达债券A	财通资管鸿达债券C	财通资管鸿达债券E
基金合同生效日的基金份额总额	893,313.42	2,842,211.65	6,001,670.79
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,737,133.73	114,596,156.92	6,168,204.94
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	151,068.14	13,063,552.10	5,971,163.74
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	5,479,379.01	104,374,816.47	6,198,711.99

### 6.2 财通资管鑫达回报混合型证券投资基金

(报告期：2019年1月1日-2019年1月2日)

单位：份

	财通资管鑫达混合A	财通资管鑫达混合C	财通资管鑫达混合E
报告期期初基金份额总额	892,334.97	2,842,211.65	6,001,670.79
报告期期间基金总申购份额	978.45	-	-
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	893,313.42	2,842,211.65	6,001,670.79

## § 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

本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

#### 7.2.1 财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金

本报告期本基金管理人无运用固有资金申购、赎回本基金的情况。

#### 7.2.2 财通资管鑫达回报混合型证券投资基金

本报告期本基金管理人无运用固有资金申购、赎回本基金的情况。

## § 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	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	20190101-20190303	3,967,860.33	0.00	3,967,860.33	0.00	0.00%
	2	20190101-20190123	1,983,930.17	0.00	1,983,930.17	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额 20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性风险，从而影响基金的投资运作和收益水平。管理人将在基金运作中加强流动性管理，保持合适的流动性水平，对申购赎回进行合理的应对，防范流动性风险，保障持有人利益。							

### 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

- 1、财通资管鑫达回报混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、财通资管鑫达回报混合型证券投资基金托管协议
- 3、财通资管鑫达回报混合型证券投资基金基金合同
- 4、财通资管鑫达回报混合型证券投资基金招募说明书
- 5、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程

- 6、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金托管协议
- 7、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金基金合同
- 8、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金招募说明书
- 9、本报告期内按照规定披露的各项公告

## 9.2 存放地点

上海市浦东新区福山路500号城建国际大厦28楼  
浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院B幢办公楼

## 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财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：95336

公司网址：[www.ctzg.com](http://www.ctzg.com)

财通证券资产管理有限公司

2019年04月22日