

财通资管新聚益6个月持有期混合型发起式证券投资基金

2022年第1季度报告

2022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:上海银行股份有限公司

报告送出日期:2022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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年04月21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2022年01月01日起至03月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	财通资管新聚益6个月持有期混合	
基金主代码	012052	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年12月24日	
报告期末基金份额总额	10,248,808.57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	1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、股票投资策略；5、金融衍生产品投资策略	
业绩比较基准	中债综合指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%	
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	上海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	财通资管新聚益6个月持有期混合A	财通资管新聚益6个月持有期混合C

下属分级基金的交易代码	012052	012053
报告期末下属分级基金的份额总额	10,179,051.87份	69,756.70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(2022年01月01日 - 2022年03月31日)	
	财通资管新聚益6个月持有期混合A	财通资管新聚益6个月持有期混合C
1. 本期已实现收益	-7,594.40	-7.57
2. 本期利润	-11,877.74	-3.10
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0012	-0.0003
4. 期末基金资产净值	10,172,007.53	69,716.92
5. 期末基金份额净值	0.9993	0.9994

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。

3.2 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

财通资管新聚益6个月持有期混合A净值表现

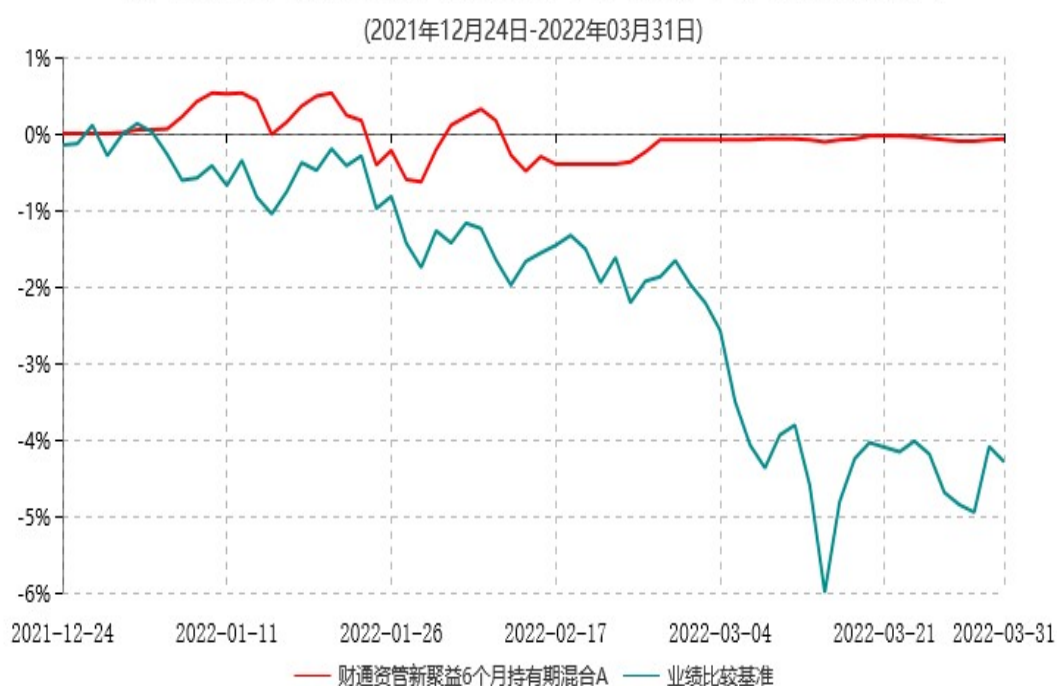
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.12%	0.17%	-4.42%	0.44%	4.30%	-0.27%
自基金合同生效起至今	-0.07%	0.16%	-4.29%	0.43%	4.22%	-0.27%

财通资管新聚益6个月持有期混合C净值表现

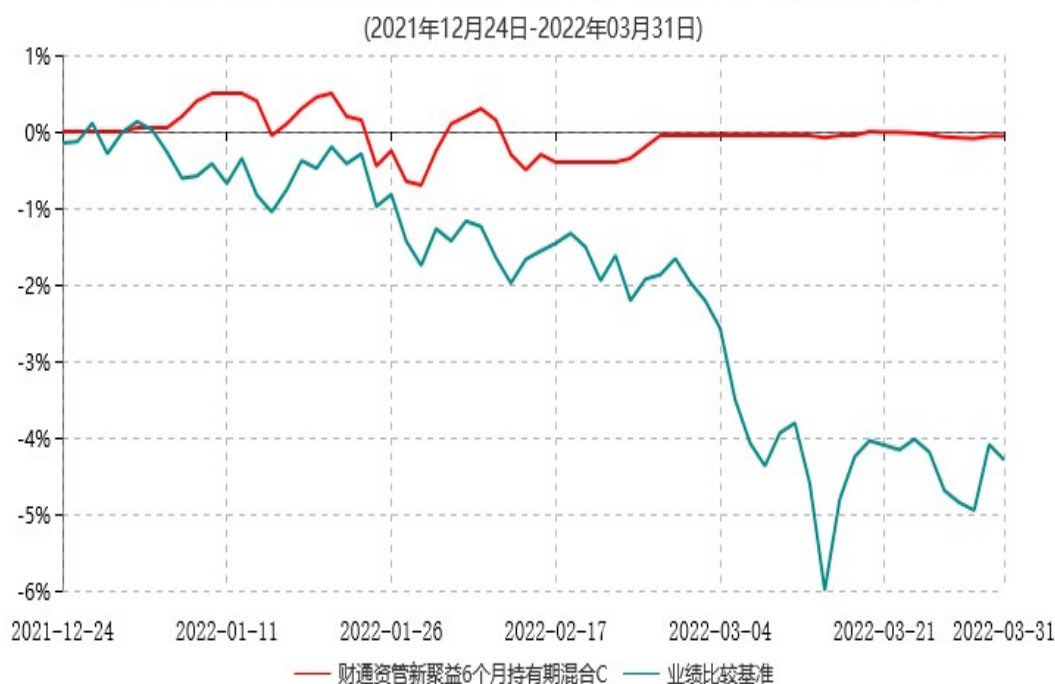
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.11%	0.17%	-4.42%	0.44%	4.31%	-0.27%
自基金合同生效起至今	-0.06%	0.17%	-4.29%	0.43%	4.23%	-0.26%

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

财通资管新聚益6个月持有期混合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



财通资管新聚益6个月持有期混合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



注：1、本基金合同于2021年12月24日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一年。
 2、本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月，报告期末本基金未建仓完毕。
 3、自基金合同生效至报告期末，财通资管新聚益6个月持有期混合A基金份额净值增长率为-0.12%，同期业绩比较基准收益率为-4.42%；财通资管新聚益6个月持有期混合C基金份额净值增长率为-0.11%，同期业绩比较基准收益率为-4.42%。

§ 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		
辛晨晨	本基金基金经理、财通资管新添益6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管智选核心回报6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金和财	2021-12-24	-	9	清华大学硕士，2012年7月加入中信建投证券任产品及金融创新部高级经理，2015年6月加入上海证券交易所基金与衍生品部，2016年6月加入嘉实资本管理有限公司任高级投资经理，2017年6月加入兴

	通资管中证钢铁指数型发起式证券投资基金基金经理。				证证券资产管理有限公司任资深投资经理,2020年8月加入财通证券资产管理有限公司,现任量化及多资产投资部总经理。
顾宇笛	本基金基金经理、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金、财通资管鸿盛12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管新添益6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金和财通资管双盈债券型发起式证券投资基金基金经理。	2021-12-24	-	7	华东师范大学经济学硕士。2014年6月至2014年12月担任财通证券股份有限公司资产管理部债券研究员;2015年1月至2017年8月担任财通证券资产管理有限公司固定收益部债券研究员,2017年8月起担任基金经理岗位。

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。

4.1.1 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

期末本基金基金经理无同时管理私募资产管理计划的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《财通资管新聚益6个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》、《财通资管新聚益6个月持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书》的约定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生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

2022年一季度权益市场风格反转，价值相对成长占优，红利低波策略表现优异。权益组合层面，在严格的回撤约束条件下组合一直维持较低仓位，所以组合整体表现回撤较小。债券投资方面，由于产品规模较小，并未参与信用债相关投资，仅参与双低策略可转债投资和部分现金管理。

展望二季度，组合将继续维持较低权益仓位运作，在积累安全垫时期，严格控制产品回撤，致力于提高持有人的持有体验。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管新聚益6个月持有期混合A基金份额净值为0.9993元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.12%，同期业绩比较基准收益率为-4.42%；截至报告期末财通资管新聚益6个月持有期混合C基金份额净值为0.9994元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.11%，同期业绩比较基准收益率为-4.42%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内无需要说明的相关情况。

§ 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	319,555.30	3.11

	其中：债券	319,555.30	3.11
	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	3,800,000.00	37.03
	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	6,037,874.09	58.84
8	其他资产	103,906.05	1.01
9	合计	10,261,335.44	100.00

注：由于四舍五入的原因，金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	319,555.30	3.12
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	319,555.30	3.12

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	110045	海澜转债	1,000	107,864.25	1.05
2	110073	国投转债	1,000	106,640.05	1.04
3	128129	青农转债	1,000	105,051.00	1.03

注：本基金报告期末仅支持有上述三只债券。

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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

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

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金对股指期货的投资以套期保值为主要目的，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行形势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

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

本基金对国债期货的投资以套期保值为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券中青农转债(证券代码：128129)的发行主体在本报告编制日前一年内受到公开处罚。报告期内本基金投资的前十名证券的其他发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日一年以内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券之一青农转债(证券代码：128129)的发行主体青岛农村商业银行股份有限公司于2022年1月26日收到处罚决定书(青银保监罚决字(2022)1号)，并处人民币4410万元罚款；于2021年10月18日收到处罚决定书(青银保监罚决字(2021)53号)，并处人民币200万元罚款。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资有严格的投资决策流程控制，本基金对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上，本基金严格执行公司个券审核流程。在对该证券的持有过程中，研究员密切关注证券发行主体动向，在上述处罚发生时及时分析其对该投资决策的影响。经过分析认为此事件对该证券发行主体的财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，因此不影响对该证券基本面和投资价值的判断。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,330.13
2	应收证券清算款	100,575.92
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	103,906.05

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	110045	海澜转债	107,864.25	1.05
2	110073	国投转债	106,640.05	1.04
3	128129	青农转债	105,051.00	1.03

5.11.5 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

单位：份

	财通资管新聚益6个月 持有期混合A	财通资管新聚益6个月 持有期混合C
报告期期初基金份额总额	10,099,962.33	20.01
报告期期间基金总申购份额	79,089.54	69,736.69
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	10,179,051.87	69,756.70

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 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

	财通资管新聚益6个月 持有期混合A	财通资管新聚益6个月 持有期混合C
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（%）	97.57	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人无运用固有资金申购、赎回本基金的情况。

§ 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	10,000,000.00	97.57%	10,000,000.00	97.57%	自基金合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	49,980.05	0.49%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	9,994.01	0.10%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,059,974.06	98.16%	10,000,000.00	97.57%	自基金合同生效之日起不少于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	20220101-20220331	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	97.57%
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。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、财通资管新聚益6个月持有期混合型发起式证券投资基金相关批准文件
- 2、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程
- 3、财通资管新聚益6个月持有期混合型发起式证券投资基金托管协议
- 4、财通资管新聚益6个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同
- 5、财通资管新聚益6个月持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书
- 6、本报告期内按照规定披露的各项公告

10.2 存放地点

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层
浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院B幢办公楼

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财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：95336

公司网址：www.ctzg.com

财通证券资产管理有限公司

2022年04月22日