

财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2024年8月9日

送出日期：2024年9月13日

**本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。**

一、产品概况

基金简称	财通资管鸿运中短债债券	基金代码	006799
下属基金简称	财通资管鸿运中短债债券 A	下属基金代码	006799
下属基金简称	财通资管鸿运中短债债券 C	下属基金代码	006800
下属基金简称	财通资管鸿运中短债债券 E	下属基金代码	008922
下属基金简称	财通资管鸿运中短债债券 I	下属基金代码	021807
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2019年1月21日		
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期
周庆	2020年10月29日		2016年3月1日
朱红	2022年6月23日		2016年1月18日
其他	本基金自2020年5月8日起增加E类基金份额；自2024年7月4日起增加I类基金份额。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资者可阅读本基金招募说明书“基金的投资”章节了解详细情况。

投资目标	在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，重点投资中短债主题证券，力争使基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、政府支持机构债、政府支持债、地方政府债、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相

关规定。

本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

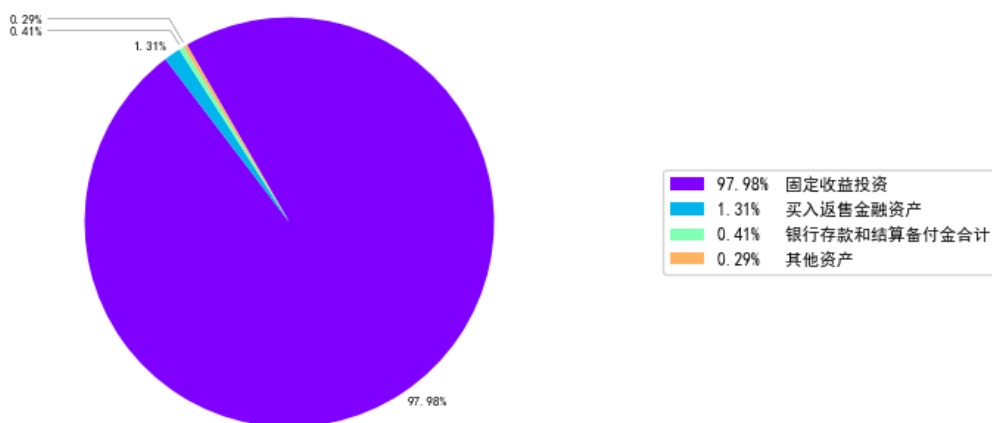
本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金所指的中短债主题证券是指剩余期限不超过三年的债券资产，主要包括国债、金融债、企业债、公司债、中期票据、政府支持机构债、政府支持债、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。

主要投资策略	1、资产配置策略；2、固定收益类投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、国债期货投资策略
业绩比较基准	中债总财富(1-3年)指数收益率×85%+一年期定期存款利率(税后)×15%
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。

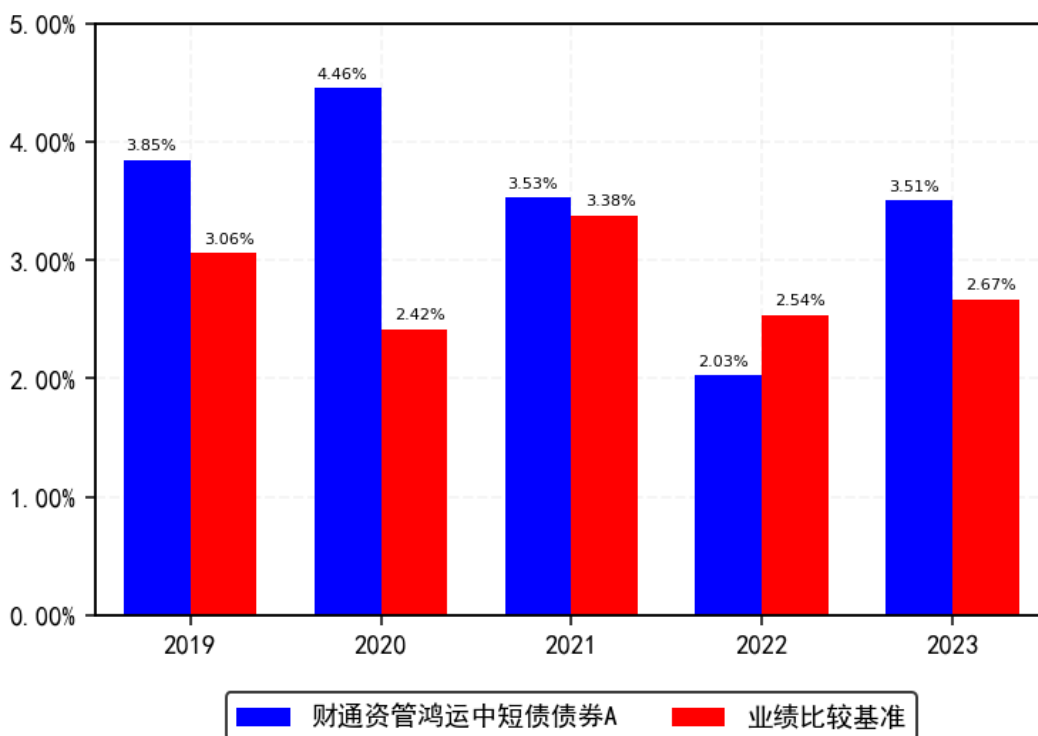
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图（2024年6月30日）

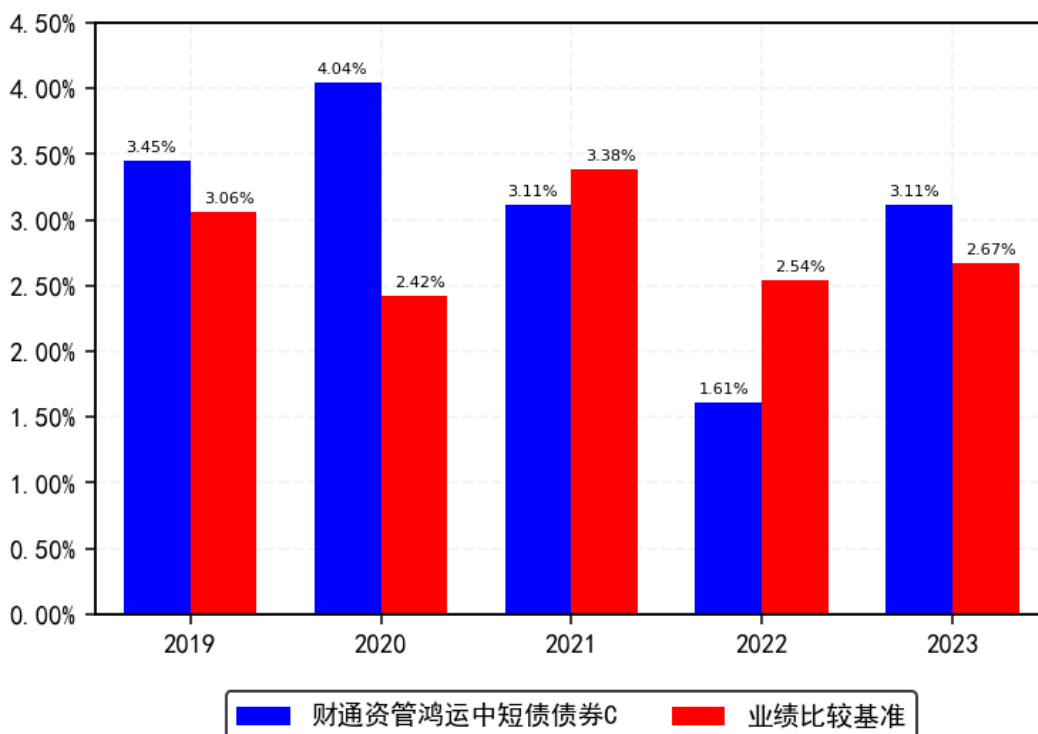


（三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

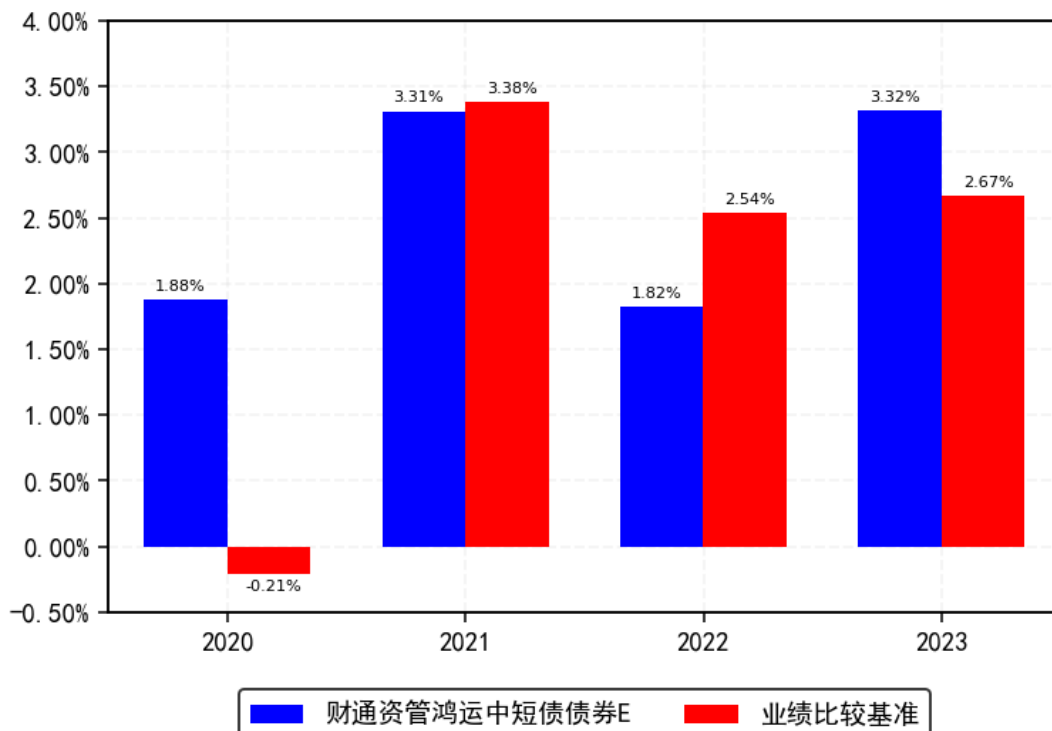
基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日



基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日



基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日



注：合同生效当年不满完整自然年度，按实际期限计算净值增长率。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

财通资管鸿运中短债债券 A

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	M < 100 万元	0.4%	非养老金客户
	M < 100 万元	0.16%	养老金客户
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.2%	非养老金客户
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.08%	养老金客户
	500 万元 ≤ M	1000 元/笔	
赎回费	N < 7 天	1.5%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.1%	
	30 天 ≤ N	0%	

财通资管鸿运中短债债券 C

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
------	---------------------------	---------	----

赎回费	N < 7 天	1.5%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.1%	
	30 天 ≤ N	0%	
财通资管鸿运中短债债券 E			
费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
赎回费	N < 7 天	1.5%	
	7 天 ≤ N	0%	
财通资管鸿运中短债债券 I			
费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	M < 100 万元	0.4%	非养老金客户
	M < 100 万元	0.16%	养老金客户
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.2%	非养老金客户
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.08%	养老金客户
	500 万元 ≤ M	1000 元/笔	
	赎回费	N < 7 天	1.5%
7 天 ≤ N		0%	

申购费 A: 投资人可以多次申购本基金, 申购费用按每笔申购申请单独计算。因红利自动再投资而产生的基金份额, 不收取相应的申购费用。申购费用由投资人承担, 不列入基金财产, 主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

申购费 I: 投资人可以多次申购本基金, 申购费用按每笔申购申请单独计算。因红利自动再投资而产生的基金份额, 不收取相应的申购费用。申购费用由投资人承担, 不列入基金财产, 主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

赎回费 A: 本基金 A 类份额的赎回费率按持有时间递减。投资者在一天之内如果有多笔赎回, 适用费率按单笔分别计算。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, 在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

赎回费 C: 本基金 C 类份额的赎回费率按持有时间递减。投资者在一天之内如果有多笔赎回, 适用费率按单笔分别计算。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, 在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

赎回费 E: 本基金 E 类份额的赎回费率按持有时间递减。投资者在一天之内如果有多笔赎回, 适用费率按单笔分别计算。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, 在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

赎回费 I: 本基金 I 类份额的赎回费率按持有时间递减。投资者在一天之内如果有多笔赎回, 适用费率按单笔分别计算。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, 在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.30%	基金管理人和销售机构
托管费	0.08%	基金托管人
销售服务费 C	0.40%	销售机构
销售服务费 E	0.40%	销售机构
审计费用	115,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、诉讼费和仲裁费，基金份额持有人大会费用，基金的证券交易费用，基金的银行汇划费用，基金相关账户的开户及维护费用，按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。	

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

财通资管鸿运中短债债券 A

基金运作综合费率（年化）

0.39%

财通资管鸿运中短债债券 C

基金运作综合费率（年化）

0.79%

财通资管鸿运中短债债券 E

基金运作综合费率（年化）

0.79%

财通资管鸿运中短债债券 I

基金运作综合费率（年化）

0.39%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、本基金特有的风险

本基金属于债券型基金，投资范围包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、政府支持机构债、政府支持债、地方政府债、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、协议存款、

通知存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。因此本基金将受到来自固定收益市场、衍生品市场等方面风险：一方面如果固定收益市场系统性风险爆发或对各类固定收益金融工具的选择不准确都将对本基金的净值表现造成不利影响；另一方面，尽管本基金以套期保值为目的参与衍生品投资，但是由于衍生品通常具有杠杆效应，价格剧烈波动时将会对本基金的净值造成影响。

2、投资资产支持证券的特定风险

本基金可投资资产支持证券，投资资产支持证券可能面临资产支持证券的标的信用风险、流动性风险，及证券化过程中的法律风险等，由此可能导致基金或基金份额持有人利益受损。

3、投资衍生品的特定风险

本基金可投资于国债期货等金融衍生品，投资国债期货等金融衍生品所面临的风险主要是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险和操作风险。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，并且其定价相当复杂，不适当的估值也有可能使基金资产面临损失风险。

4、本基金参与债券回购的风险

债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

5、实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险，但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时拥有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时以主袋账户资产为基准，不反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

6、开放式基金共有的风险如市场风险、管理风险、流动性风险和其他风险。

(二) 重要提示

以下资料详见财通证券资产管理有限公司网站[www.ctzg.com][客服电话:400-116-7888]

财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金基金合同、托管协议、招募说明书
定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告
基金份额净值
基金销售机构及联系方式
其他重要资料

五、其他资料查询方式

以下资料详见财通证券资产管理有限公司网站[www.ctzg.com][客服电话:400-116-7888]

- 财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

六、其他情况说明

暂无