
财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金

2022年第3季度报告

2022年09月30日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2022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规定，于2022年10月25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07月01日起至09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	财通资管睿达一年定开债券发起式
基金主代码	015330
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2022年05月11日
报告期末基金份额总额	3,010,059,200.02份
投资目标	在严格控制风险的基础上，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、可转换债券和可交换债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、国债期货投资策略；6、开放期投资策略。
业绩比较基准	中债综合指数（全价）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	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（2022年07月01日 - 2022年09月30日）
1. 本期已实现收益	36,138,656.46
2. 本期利润	60,094,843.47
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0200
4. 期末基金资产净值	3,035,770,497.11
5. 期末基金份额净值	1.0085

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。

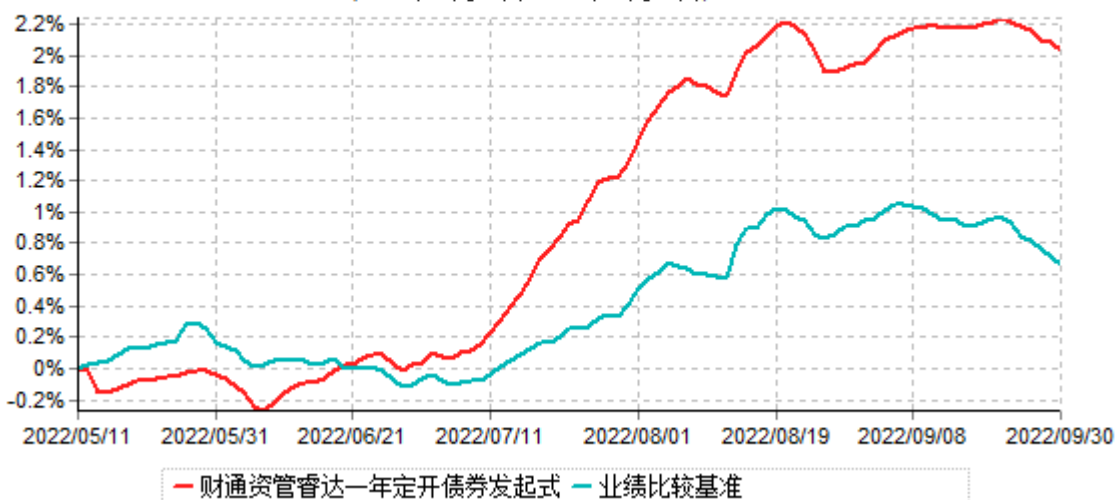
3.2 基金净值表现

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	1.99%	0.06%	0.73%	0.05%	1.26%	0.01%
自基金合同生效起至今	2.03%	0.05%	0.67%	0.04%	1.36%	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

财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年05月11日-2022年09月30日)



注：1、本基金合同于2022年3月9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6个月，截止报告期末，本基金尚未建仓完毕。

§ 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		
夏金涛	本基金基金经理、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金、财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管睿慧1年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管鸿享30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金和	2022-05-11	-	6	上海交通大学应用统计硕士。2016年3月起加入财通证券资产管理有限公司，历任固定收益部产品经理助理、固收公募投资部基金经理助理。

	财通资管中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理。				
王亚军	本基金基金经理、财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金、财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管睿慧1年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管中债1-3年国开行债券指数证券投资基金和财通资管鸿享30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。	2022-05-11	-	3	金融学硕士，曾任北京银行资金交易部交易员；工商银行金融市场部交易员；阜新银行北京拓展部副总经理；成都银行资金部副总经理。2019年4月加入财通证券资产管理有限公司。

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《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》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《财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》、《财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、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

从基本面来看，三季度经济延续弱修复态势。8月经济环比有所修复但依然偏弱，8月制造业PMI回升0.4个百分点至49.4%，主要为新订单指数回升，而生产指数则持平前值，产成品仍在加速去库。8月非制造业PMI回落1.2个百分点至52.6%，基本面较7月改善幅度不大。8月CPI同比上涨2.5%，较上月回落0.2个百分点；PPI同比上涨2.3%，较上月继续大幅回落1.9个百分点，均低于市场预期。8月社会融资规模2.43万亿元，同比少增5593亿元，数据高于市场一致预期；8月末，M2余额259.51万亿元，M1余额66.46万亿元，M0余额9.72万亿元。从9月份各项高频数据来看，居民出行、房地产销售、港口贸易等数据均未出现显著的环比改善。而从9月PMI来看，读数环比微升0.3点至48.8%，仍然显著低于季节性水平。总体上看，9月经济景气边际改善但斜率偏平缓。

政策方面，财政政策进一步发力稳定经济，国常会再部署的3000亿元政策性开发性金融工具已发行2500亿，为后续基建项目提供资本金支持。货币政策方面，8月央行超预期下调MLF与OMO利率10bp，并非对称调降1年期LPR 5bp、5年期及以上LPR 10bp。9月降息后，央行进入政策效果观察期，叠加海外货币收紧带来的汇率压力，并未进一步实施降息操作。但基于国内基本面的情况看，货币政策宽松的窗口期并未关闭。

海外方面，欧美央行集体大幅加息，其中美联储9月议息会议宣布加息75bp，为年内第三次以75bp的幅度加息。鲍威尔在新闻发布会上表示，经济回落与通胀率上升是治理通胀过程中几乎必然的代价。受美联储加息等影响，人民币汇率贬值压力增加，使国内金融市场普遍出现波动，目前央行已采用外汇存款准备金、远期售汇风准等工具管理汇率。在国内基本面仍然偏弱、信贷投放情况不佳的背景下，或许尚不必担忧央行采用收紧国内流动性的方式来应对贬值压力。

本基金主要以持有中高等级信用债为主，根据市场趋势及时调整组合久期与杠杆，力争在保证安全性和流动性的前提下增厚整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管睿达一年定开债券发起式基金份额净值为1.0085元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.99%，同期业绩比较基准收益率为0.73%。

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	4,467,304,584.66	99.63
	其中：债券	4,467,304,584.66	99.63
	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	16,332,019.56	0.36
8	其他资产	184,419.53	0.00
9	合计	4,483,821,023.75	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

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	173,465,065.75	5.71
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,144,287,353.72	70.63
5	企业短期融资券	10,081,813.70	0.33
6	中期票据	2,139,470,351.49	70.48
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,467,304,584.66	147.16

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	1922034	19建信金融债02	1,700,000	173,465,065.75	5.71
2	102101438	21国兴投资MTN001	1,300,000	134,115,052.05	4.42
3	2280302	22钱投债01	1,300,000	132,250,389.04	4.36
4	1980354	19台循债	1,200,000	130,127,408.22	4.29
5	102100130	21环太湖MTN001	1,000,000	105,585,830.14	3.48

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

本基金投资范围未包含股指期货。

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。

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。

5.11.2 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	184,419.53
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	184,419.53

5.11.4 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。

5.11.5 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

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	3,010,059,200.02
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	3,010,059,200.02

§ 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	10,000,200.02
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	10,000,200.02
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.33

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	10,000,200.02	0.33%	10,000,200.02	0.33%	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	-	-	-	-	-

基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,200.02	0.33%	10,000,200.02	0.33%	-

§ 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	20220701-20220930	3,000,059.00 0.00	-	-	3,000,059.00 0.00	99.67%
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

1、报告期内，本基金管理人上海分公司住所于2022年8月2日变更至上海市虹口区东大名路501号4503、4504室。

2、本基金管理人于2022年9月16日发布《财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告》，本次分红以2022年9月14日为收益分配基准日，对2022年9月19日登记在册的基金份额持有人按0.118元/10份基金份额进行收益分配。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、财通资管睿达一年定期开放债券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、财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议
- 4、财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 5、财通资管睿达一年定期开放债券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10月26日