
财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	财通资管鸿睿12个月定开债券	
基金主代码	005684	
基金运作方式	契约型、定期开放式	
基金合同生效日	2018年08月10日	
报告期末基金份额总额	1,983,636,224.12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、国债期货投资策略；5、开放期投资策略。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率	
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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	财通资管鸿睿12个月定开债券A	财通资管鸿睿12个月定开债券C
下属分级基金的交易代码	005684	005685

报告期末下属分级基金的份额总额	1, 884, 131, 867. 92份	99, 504, 356. 20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07月01日 - 2022年09月30日)	
	财通资管鸿睿12个月定开债券A	财通资管鸿睿12个月定开债券C
1. 本期已实现收益	5, 457, 050. 96	632, 779. 73
2. 本期利润	1, 616, 016. 83	483, 086. 98
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0029	0. 0099
4. 期末基金资产净值	2, 221, 713, 543. 30	115, 315, 155. 62
5. 期末基金份额净值	1. 1792	1. 1589

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

财通资管鸿睿12个月定开债券A净值表现

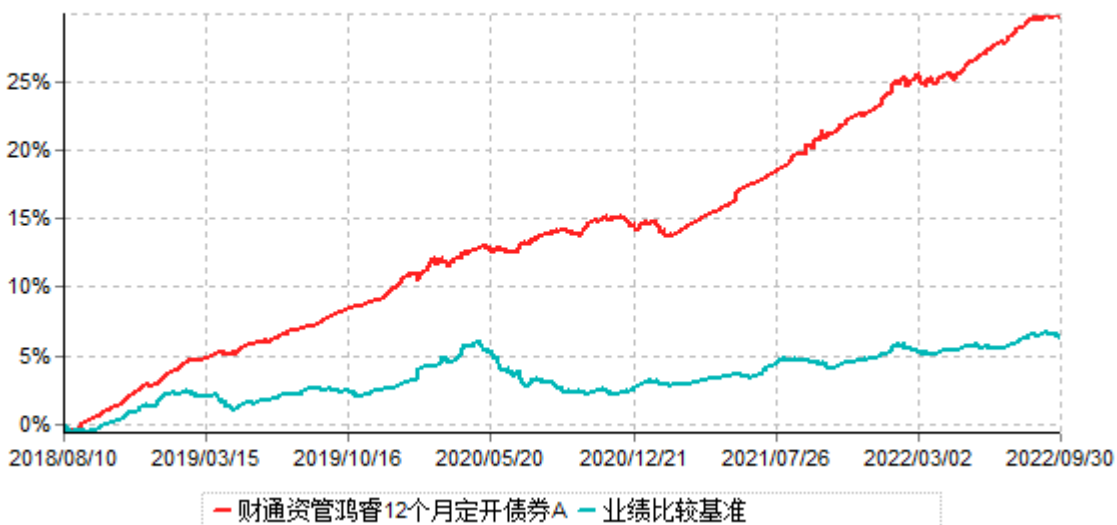
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1. 51%	0. 07%	0. 73%	0. 05%	0. 78%	0. 02%
过去六个月	3. 72%	0. 07%	1. 03%	0. 04%	2. 69%	0. 03%
过去一年	7. 18%	0. 09%	1. 73%	0. 05%	5. 45%	0. 04%
过去三年	19. 89%	0. 08%	3. 81%	0. 07%	16. 08%	0. 01%
自基金合同生效起至今	29. 67%	0. 07%	6. 28%	0. 06%	23. 39%	0. 01%

财通资管鸿睿12个月定开债券C净值表现

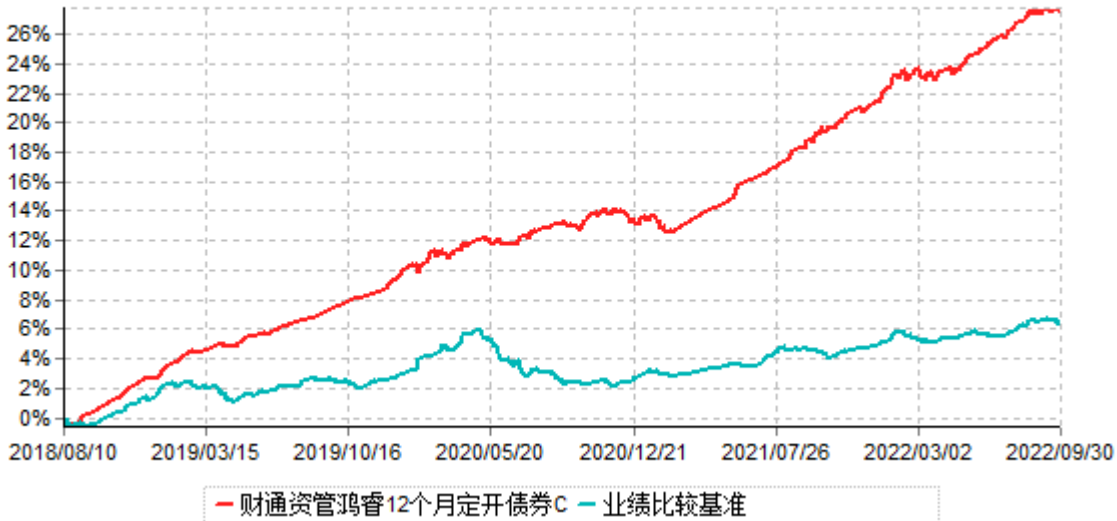
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.40%	0.07%	0.73%	0.05%	0.67%	0.02%
过去六个月	3.51%	0.07%	1.03%	0.04%	2.48%	0.03%
过去一年	6.75%	0.09%	1.73%	0.05%	5.02%	0.04%
过去三年	18.45%	0.08%	3.81%	0.07%	14.64%	0.01%
自基金合同生效起至今	27.52%	0.07%	6.28%	0.06%	21.24%	0.01%

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

财通资管鸿睿12个月定开债券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08月10日-2022年09月30日)



财通资管鸿睿12个月定开债券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08月10日-2022年09月30日)



§ 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		
陈希希	本基金基金经理、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管鑫管家货币市场基金、财通资管鸿安30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管鸿启90天滚动持有中短债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、财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金和财通资管鸿商中短	2018-08-10	-	11	金融学学士，2010年10月至2012年9月担任日信证券股份有限公司固定收益部债券交易员，2012年10月至2014年12月担任财通证券股份有限公司资产管理部高级债券交易员，2014年12月至2015年7月担任财通证券资产管理有限公司固定收益部高级债券交易员，2015年7月至2017年7月期间担任财通证券资产管理有限公司固定收益部投资主办。

	债债券型证券投资基金基金经理。				
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、财通资管双盈债券型发起式证券投资基金、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和财通资管双福9个月持有期债券型发起式证券投资基金基金经理。	2019-03-26	-	8	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《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《财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《财通资管鸿睿12个月定期开放债券型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EPMI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。

本基金主要以持有较高等级信用债为主，并保持适当杠杆增厚产品收益。转债方面，三季度转债市场经历了先涨后跌的走势，中证转债指数的收益率为-3.82%，经过调整后转债市场的估值水平有所压缩，当前估值处于历史中等偏高位置。本基金持仓结构较为均衡，考虑到当前债市收益率仍处于较低水平，结构性资产荒仍旧存在且转债的相对底部较股票更易判断，转债市场仍然具备一定机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管鸿睿12个月定开债券A基金份额净值为1.1792元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.51%，同期业绩比较基准收益率为0.73%；截至报告期末财通资管鸿睿12个月定开债券C基金份额净值为1.1589元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.40%，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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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	2,309,730,698.80	96.87
	其中：债券	2,309,730,698.80	96.87
	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	68,706,048.52	2.88
	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	5,893,979.81	0.25
8	其他资产	2,643.37	0.00
9	合计	2,384,333,370.50	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	570,184,150.68	24.40
	其中：政策性金融债	570,184,150.68	24.40
4	企业债券	187,502,162.17	8.02
5	企业短期融资券	945,194,220.84	40.44
6	中期票据	391,960,422.18	16.77
7	可转债（可交换债）	214,889,742.93	9.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,309,730,698.80	98.83

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	180214	18国开14	1,000,000	108,965,753.42	4.66
2	200315	20进出15	1,000,000	106,283,260.27	4.55
3	210203	21国开03	1,000,000	104,566,712.33	4.47
4	220215	22国开15	1,000,000	100,828,219.18	4.31
5	220407	22农发07	1,000,000	99,440,273.97	4.25

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、回避市场风险为主要目的，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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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	2,643.37
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	2,643.37

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	113530	大丰转债	10,451,435.35	0.45
2	127034	绿茵转债	6,800,373.46	0.29
3	127016	鲁泰转债	6,448,996.66	0.28
4	113054	绿动转债	6,383,256.81	0.27
5	110067	华安转债	5,996,482.74	0.26
6	128105	长集转债	5,797,886.53	0.25
7	127018	本钢转债	5,732,252.06	0.25
8	113604	多伦转债	5,515,818.27	0.24
9	110062	烽火转债	5,328,702.94	0.23
10	128116	瑞达转债	5,061,364.50	0.22
11	113627	太平转债	5,046,043.68	0.22
12	113639	华正转债	4,780,014.14	0.20
13	123076	强力转债	4,685,661.57	0.20
14	110047	山鹰转债	4,675,887.74	0.20
15	123099	普利转债	4,660,988.65	0.20
16	123049	维尔转债	4,642,639.46	0.20
17	110060	天路转债	4,608,032.88	0.20
18	123128	首华转债	4,509,595.38	0.19
19	123113	仙乐转债	4,369,092.91	0.19
20	127024	盈峰转债	4,062,694.37	0.17
21	127047	帝欧转债	3,994,008.77	0.17
22	110063	鹰19转债	3,843,560.00	0.16

23	123004	铁汉转债	3,332,667.38	0.14
24	110045	海澜转债	3,255,238.36	0.14
25	128035	大族转债	3,249,033.70	0.14
26	123108	乐普转2	3,194,180.82	0.14
27	123056	雪榕转债	3,182,393.84	0.14
28	113535	大业转债	2,927,830.87	0.13
29	113601	塞力转债	2,886,612.53	0.12
30	123096	思创转债	2,675,925.84	0.11
31	127025	冀东转债	2,645,740.37	0.11
32	123117	健帆转债	2,581,982.59	0.11
33	128133	奇正转债	2,459,770.59	0.11
34	123119	康泰转2	2,445,149.59	0.10
35	113593	沪工转债	2,423,645.24	0.10
36	113532	海环转债	2,249,967.12	0.10
37	132018	G三峡EB1	2,142,626.71	0.09
38	113605	大参转债	1,651,385.75	0.07
39	127041	弘亚转债	1,645,277.26	0.07
40	128138	侨银转债	1,525,712.36	0.07
41	113017	吉视转债	1,501,811.58	0.06
42	128124	科华转债	1,488,030.61	0.06
43	110072	广汇转债	1,459,017.95	0.06
44	113606	荣泰转债	1,389,313.14	0.06
45	128049	华源转债	1,346,515.23	0.06
46	123129	锦鸡转债	1,205,386.51	0.05
47	113563	柳药转债	1,119,927.01	0.05
48	113609	永安转债	1,095,389.86	0.05
49	127042	嘉美转债	1,093,230.82	0.05
50	128129	青农转债	1,026,548.77	0.04
51	123109	昌红转债	977,595.71	0.04
52	113608	威派转债	951,218.42	0.04
53	128034	江银转债	767,959.23	0.03
54	128108	蓝帆转债	766,965.58	0.03
55	123010	博世转债	681,030.92	0.03

56	110043	无锡转债	614,106.43	0.03
57	128130	景兴转债	584,499.73	0.03
58	113542	好客转债	551,902.74	0.02
59	110076	华海转债	550,874.66	0.02
60	128131	崇达转2	550,398.01	0.02
61	113623	凤21转债	549,014.38	0.02
62	127022	恒逸转债	548,189.25	0.02
63	113584	家悦转债	521,993.15	0.02
64	110073	国投转债	521,503.70	0.02
65	128114	正邦转债	499,991.64	0.02
66	113569	科达转债	228,677.87	0.01
67	113610	灵康转债	66,483.85	0.00

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。

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

	财通资管鸿睿12个月定 开债券A	财通资管鸿睿12个月定 开债券C
报告期期初基金份额总额	157,797,623.12	33,651,428.28
报告期期间基金总申购份额	1,842,693,740.26	81,196,609.85
减：报告期期间基金总赎回份额	116,359,495.46	15,343,681.93
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	1,884,131,867.92	99,504,356.20

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

	财通资管鸿睿12个月 定开债券A	财通资管鸿睿12个月 定开债券C
报告期期初管理人持有的本基金份 额	27,552,351.21	-
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	27,552,351.21	-
报告期期末持有的本基金份额占基 金总份额比例 (%)	1.39	-

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 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型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、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金托管协议
- 4、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金基金合同
- 5、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型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

9.2 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

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

财通证券资产管理有限公司

2022年10月26日