

财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金

2019年第2季度报告

2019年06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:宁波银行股份有限公司

报告送出日期:2019年07月18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7月15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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | | | |
|-------------|---|--------|--------|
| 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 | | |
| 转型后基金合同生效日 | 2019年01月03日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 148,971,386.41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 | 财通资管鸿达 | 财通资管鸿达 |

| | | | |
|-----------------|---------------|--------------------|------------------|
| | 债券A | 债券C | 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 | 732, 081. 62份 | 146, 863, 651. 09份 | 1, 375, 653. 70份 |

注：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 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(2019年04月01日 - 2019年06月30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 | 17, 140. 88 | 1, 105, 046. 12 | 23, 784. 14 |
| 2. 本期利润 | 9, 636. 95 | 966, 913. 85 | 15, 468. 98 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0052 | 0. 0081 | 0. 0057 |
| 4. 期末基金资产净值 | 761, 772. 81 | 152, 085, 958. 27 | 1, 416, 212. 49 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1. 0406 | 1. 0356 | 1. 0295 |

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 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 |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|---------|
| 过去三个月 | 0. 84% | 0. 02% | -0. 24% | 0. 06% | 1. 08% | -0. 04% |

财通资管鸿达债券C净值表现

| 阶段 | 净值增长 | 净值增长 | 业绩比较 | 业绩比较基 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|-------|-----|-----|
|----|------|------|------|-------|-----|-----|

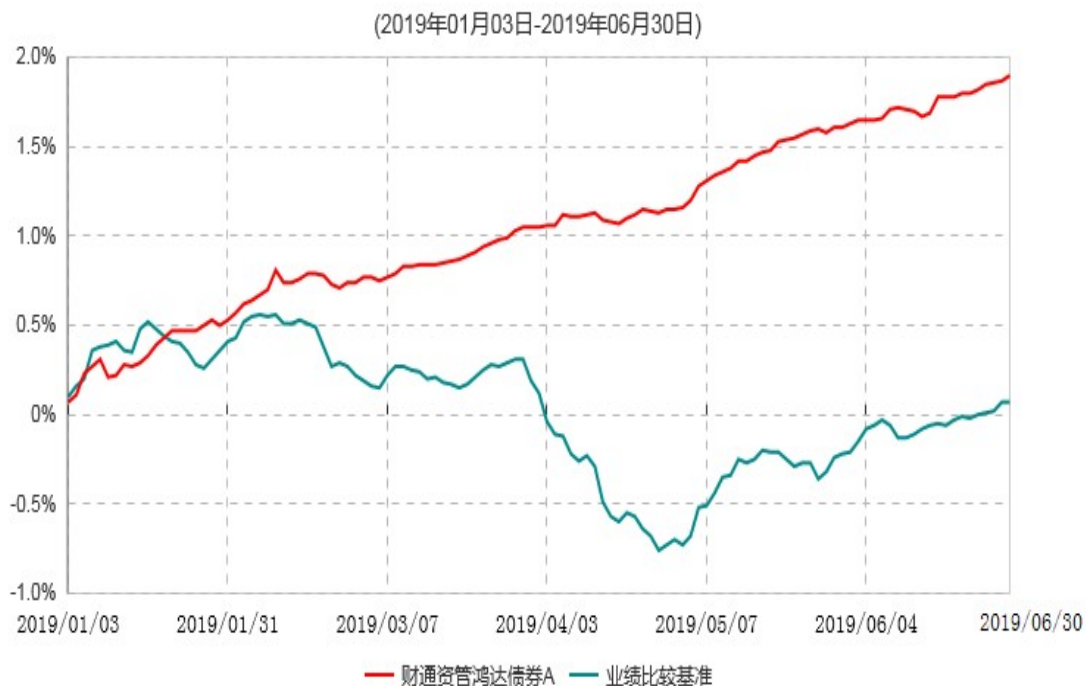
| | | | | | | |
|-------|-------|-----------|------------|--------------|-------|--------|
| | 率① | 率标准差 ② | 基准收益 率③ | 准收益率标 准差④ | | |
| 过去三个月 | 0.80% | 0.02% | -0.24% | 0.06% | 1.04% | -0.04% |

财通资管鸿达债券E净值表现

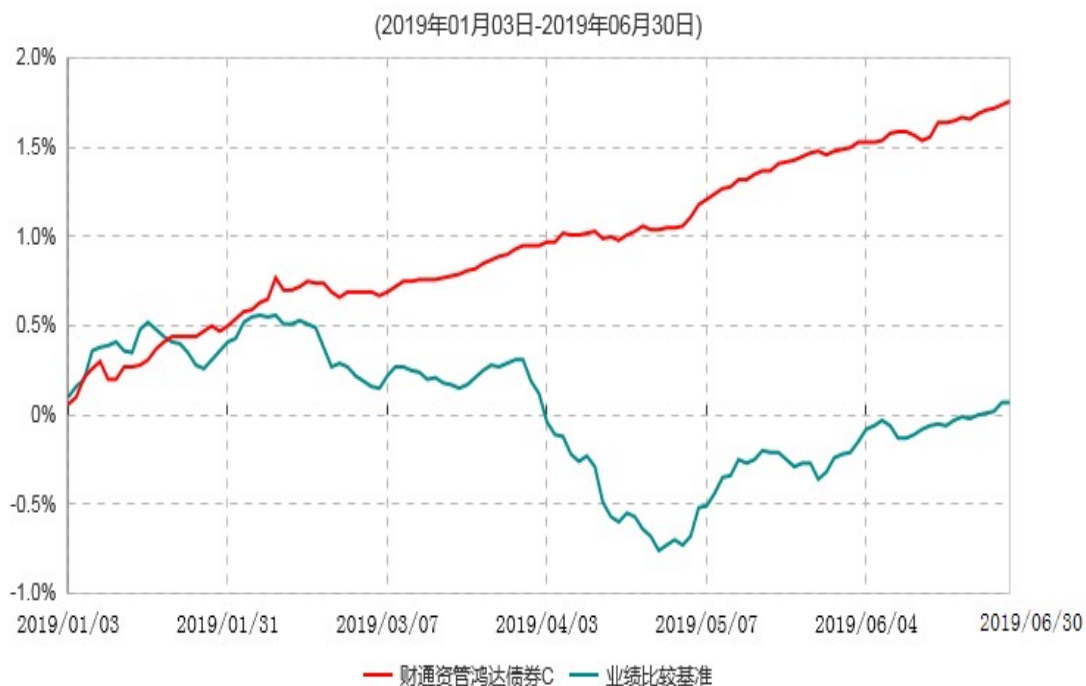
| | | | | | | |
|-------|------------|-------------------|--------------------|-----------------------|-------|--------|
| 阶段 | 净值增长 率① | 净值增长 率标准差 ② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
| 过去三个月 | 0.81% | 0.02% | -0.24% | 0.06% | 1.05% | -0.04% |

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

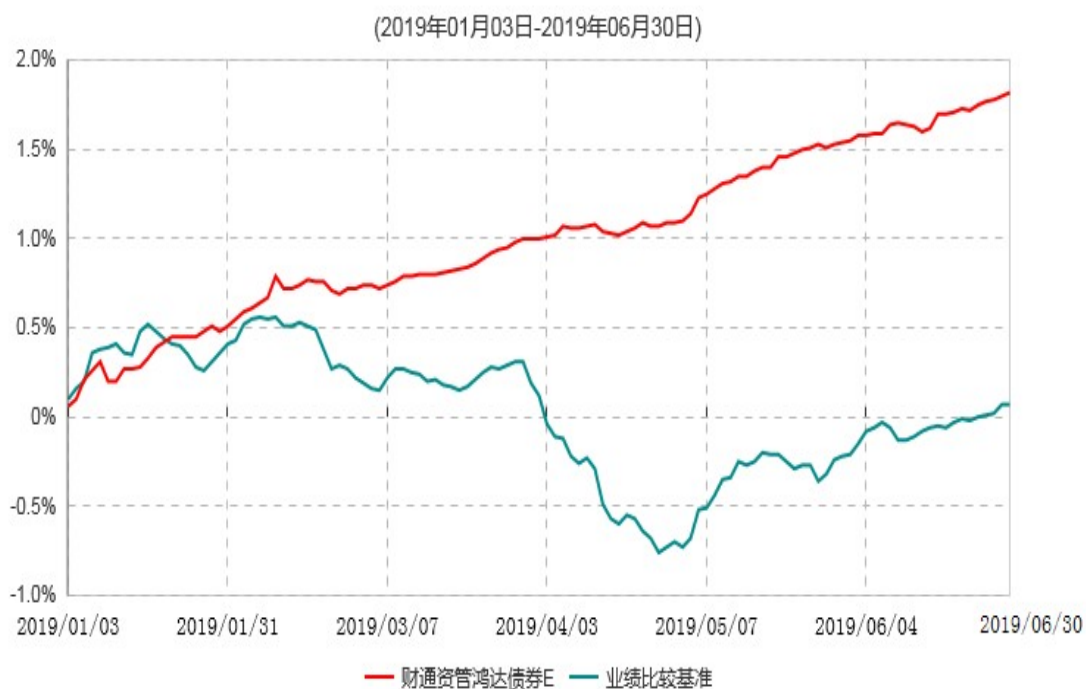
财通资管鸿达债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



财通资管鸿达债券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



财通资管鸿达债券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



- 注：1、本基金转型日期为2019年1月3日，截至报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。
- 2、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、本基金建仓期为自基金转型日起的6个月，报告期末本基金未建仓完毕。

4、自基金转型至报告期末，财通资管鸿达债券A基金份额净值增长率为1.90%，同期业绩比较基准收益率为0.07%；财通资管鸿达债券C基金份额净值增长率为1.76%，同期业绩比较基准收益率为0.07%；财通资管鸿达债券E基金份额净值增长率为1.82%，同期业绩比较基准收益率为0.07%。

§ 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 | 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务；2016年3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

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《财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金基金合同》、《财通资管鸿达纯债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

投资策略和运作分析：

宏观经济和政策回顾：2019年二季度国内外形势比较复杂。从外部来看，受贸易摩擦及英国脱欧等因素影响，全球各大经济体都受到不同程度的下行压力，并呈现衰退迹象。国内方面，贸易摩擦拖累出口增速；但在积极财政政策的支持下，基建投资低位有所企稳；房地产投资增速仍然处于较高水平，消费对经济增长的贡献度稳步提升，显示我国经济增长的韧性较强，增长的动力也在转换。物价方面，二季度受猪肉和其他食品影响，CPI明显反弹；而PPI继续下行趋势。政策方面，央行重提“货币总闸门”，在保持松紧适度的基调上有所收紧；财政方面通过加大降税减费力度，降低实体企业成本。五月决策层对包商银行实施托管，打破市场刚兑意识，深入推进金融供给侧结构性改革。在内外部因素影响下，二季度人民币汇率波动加大，出现较大幅度的贬值，当前已经企稳并有所回升。股市和债市双双出现大幅波动，整体呈震荡走势。其中10年期国债上行10bp，高等级信用债先上后下整体表现平稳，而低资质信用债利差明显走阔，分化明显。货币市场则受包商事件和季末效应的影响，呈现明显的“分层”现象。

产品投资和运作分析：本季度主要以中高评级城投和优质产业债为主，维持适当杠杆，控制整体久期。密切关注各项宏观经济数据、政策面和市场资金面情况，对组合的信用风险和流动性风险实时监控，适度参与利率品种的波段交易，争取提高组合的超额收益，力争为投资人创造长期投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管鸿达债券A基金份额净值为1.0406元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.84%，同期业绩比较基准收益率为-0.24%；截至报告期末财通资管鸿达债券C基金份额净值为1.0356元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.80%，同期业绩比较基准收益率为-0.24%；截至报告期末财通资管鸿达债券E基金份额净值为1.0295元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.81%，同期业绩比较基准收益率为-0.24%。

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 | 166,660,295.72 | 91.21 |
| | 其中：债券 | 161,660,295.72 | 88.48 |
| | 资产支持证券 | 5,000,000.00 | 2.74 |
| 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 | 3,822,395.32 | 2.09 |
| 8 | 其他资产 | 12,231,552.19 | 6.69 |
| 9 | 合计 | 182,714,243.23 | 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 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 | 18,920,078.12 | 12.26 |
| | 其中：政策性金融债 | 18,920,078.12 | 12.26 |
| 4 | 企业债券 | 81,145,416.80 | 52.60 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,058,500.00 | 19.49 |
| 6 | 中期票据 | 30,574,100.00 | 19.82 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 962,200.80 | 0.62 |
| 10 | 合计 | 161,660,295.72 | 104.79 |

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 | 143571 | 18南水01 | 100,000 | 10,221,000.00 | 6.63 |
| 2 | 143607 | 18国君G2 | 100,000 | 10,175,000.00 | 6.60 |
| 3 | 190401 | 19农发01 | 100,000 | 9,929,000.00 | 6.44 |
| 4 | 108602 | 国开1704 | 89,010 | 8,991,078.12 | 5.83 |
| 5 | 101764041 | 17浦口城乡MTN001 | 80,000 | 8,178,400.00 | 5.30 |

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 159094 | G漳公交1 | 50,000 | 5,000,000.00 | 3.24 |

注：本基金本报告期末仅持有上述一只资产支持证券。

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

本基金报告期内未交易股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内未交易国债期货。

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 | 3,594.45 |
| 2 | 应收证券清算款 | 7,597,398.63 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,617,148.81 |
| 5 | 应收申购款 | 2,013,410.30 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 12,231,552.19 |

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。

§ 6 开放式基金份额变动

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 |
|----------|--------------|----------------|--------------|
| 报告期期初基金份 | 5,479,379.01 | 104,374,816.47 | 6,198,711.99 |

| | | | |
|-----------------------------------|--------------|----------------|--------------|
| 额总额 | | | |
| 报告期期间基金总 申购份额 | 23,594.77 | 176,753,914.08 | 1,393,547.12 |
| 减：报告期期间基 金总赎回份额 | 4,770,892.16 | 134,265,079.46 | 6,216,605.41 |
| 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 | 732,081.62 | 146,863,651.09 | 1,375,653.70 |

§ 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

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

无

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、财通资管鸿达纯债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、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金托管协议
- 4、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金基金合同
- 5、财通资管鸿达纯债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

财通证券资产管理有限公司

2019年07月18日