
财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金

2023年第4季度报告

2023年12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:宁波银行股份有限公司

报告送出日期:2024年01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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年01月18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2023年10月01日起至12月31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 | 5,948,115,232.50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、固定收益类投资策略；3、国债期货投资策略。 | | | |
| 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 鸿达债券 A | 财通资管 鸿达债券C | 财通资管 鸿达债券E | 财通资管 鸿达债券I |
| 下属分级基金的交易代码 | 005307 | 005308 | 005882 | 011067 |

| | | | | |
|-----------------|-----------------|----------------|-------------------|---------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 443,843,223.50份 | 28,366,572.08份 | 5,466,198,519.86份 | 9,706,917.06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(2023年10月01日 - 2023年12月31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 | 财通资管鸿达债券I |
| 1.本期已实现收益 | 4,632,733.96 | 206,883.73 | 42,508,868.00 | 88,609.39 |
| 2.本期利润 | 4,972,411.33 | 239,379.79 | 48,977,190.28 | 98,386.26 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0086 | 0.0083 | 0.0089 | 0.0082 |
| 4.期末基金资产净值 | 539,479,452.15 | 33,858,924.66 | 6,547,132,213.16 | 10,504,500.92 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2155 | 1.1936 | 1.1977 | 1.0822 |

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、本期已实现收益指基金本期利息收入、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 | 0.78% | 0.02% | 0.82% | 0.04% | -0.04% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.58% | 0.02% | 0.83% | 0.04% | 0.75% | -0.02% |
| 过去一年 | 3.83% | 0.02% | 2.06% | 0.04% | 1.77% | -0.02% |

| | | | | | | |
|----------|--------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 过去三年 | 9.81% | 0.02% | 4.74% | 0.05% | 5.07% | -0.03% |
| 自基金转型起至今 | 19.03% | 0.03% | 5.86% | 0.06% | 13.17% | -0.03% |

财通资管鸿达债券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 | 0.70% | 0.02% | 0.82% | 0.04% | -0.12% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.42% | 0.01% | 0.83% | 0.04% | 0.59% | -0.03% |
| 过去一年 | 3.51% | 0.02% | 2.06% | 0.04% | 1.45% | -0.02% |
| 过去三年 | 8.83% | 0.02% | 4.74% | 0.05% | 4.09% | -0.03% |
| 自基金转型起至今 | 17.28% | 0.02% | 5.86% | 0.06% | 11.42% | -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 | 0.75% | 0.02% | 0.82% | 0.04% | -0.07% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.53% | 0.01% | 0.83% | 0.04% | 0.70% | -0.03% |
| 过去一年 | 3.72% | 0.02% | 2.06% | 0.04% | 1.66% | -0.02% |
| 过去三年 | 9.42% | 0.02% | 4.74% | 0.05% | 4.68% | -0.03% |
| 自基金转型起至今 | 18.46% | 0.02% | 5.86% | 0.06% | 12.60% | -0.04% |

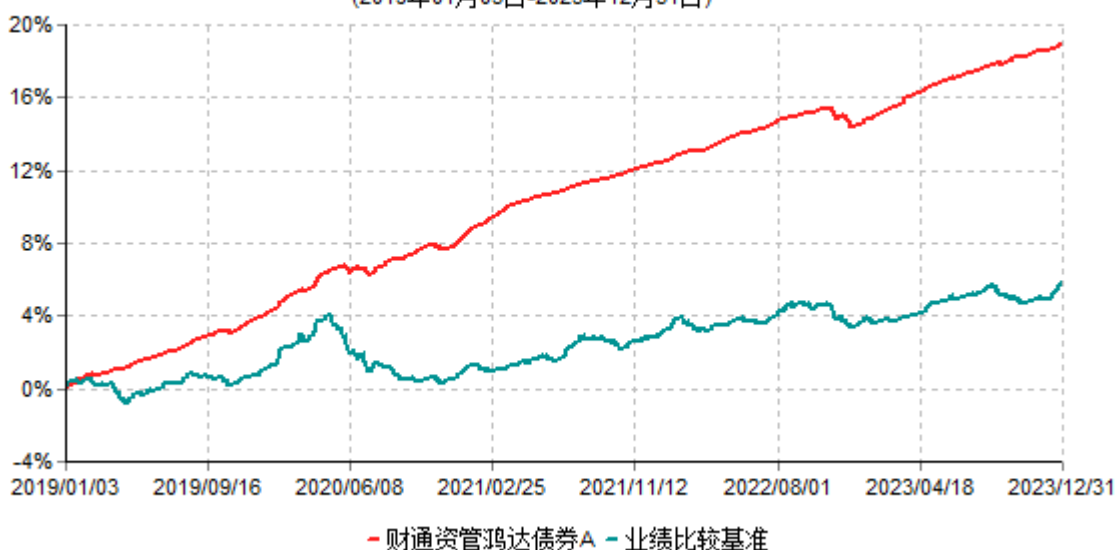
财通资管鸿达债券I净值表现

| 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 | 0.69% | 0.01% | 0.82% | 0.04% | -0.13% | -0.03% |
| 过去六个月 | 1.42% | 0.01% | 0.83% | 0.04% | 0.59% | -0.03% |

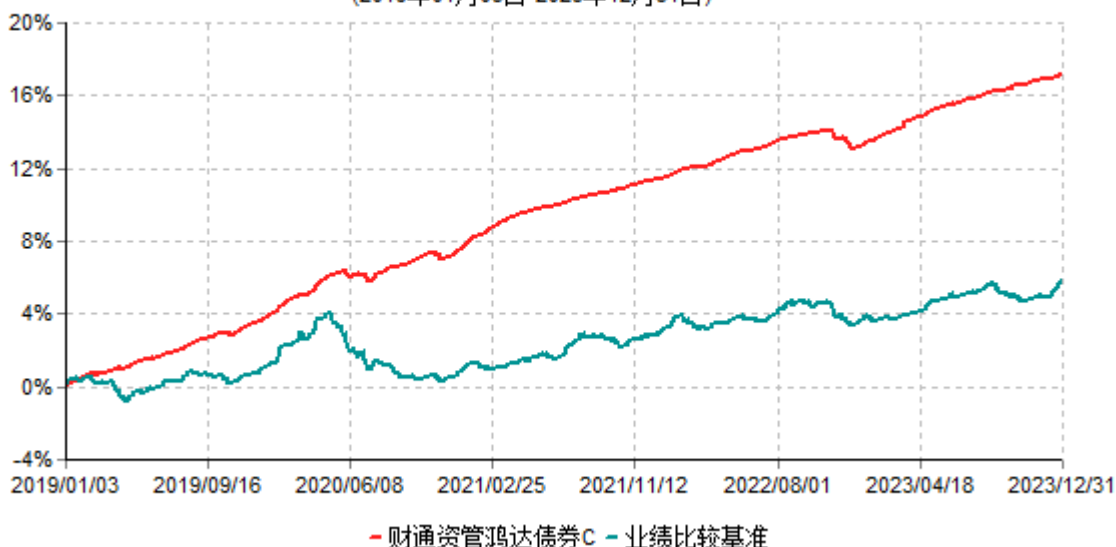
| | | | | | | |
|----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 过去一年 | 3.49% | 0.02% | 2.06% | 0.04% | 1.43% | -0.02% |
| 过去三年 | 8.22% | 0.02% | 4.74% | 0.05% | 3.48% | -0.03% |
| 自基金转型起至今 | 8.22% | 0.02% | 4.84% | 0.05% | 3.38% | -0.03% |

3.2.2 自基金转型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

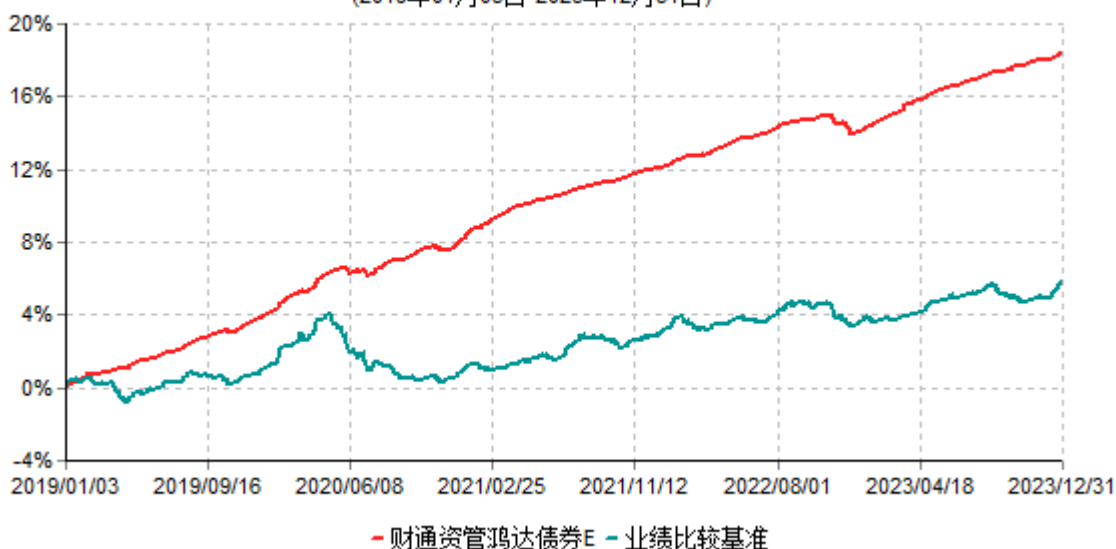
财通资管鸿达债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年01月03日-2023年12月31日)



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
(2019年01月03日-2023年12月31日)



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
(2019年01月03日-2023年12月31日)



财通资管鸿达债券I累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年12月30日-2023年12月31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、财通资管丰和两年定 | 2020-12-10 | - | 13 | 本科学历、学士学位。曾在日信证券有限责任公司、财 |

| | | | | | |
|----|---|------------|---|---|--|
| | <p>期开放债券型证券投资基金、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、财通资管鸿商中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金和财通资管现金聚财货币市场基金基金经理。</p> | | | | <p>通证券股份有限公司工作。2014年12月加入财通证券资产管理有限公司，曾任固定收益部高级交易员、固收私募投资部高级交易员、固收私募投资部投资主办，现任固收公募投资部基金经理。</p> |
| 王珊 | <p>本基金基金经理、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金、财通资管鸿慧中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管鸿商中短债债券型证券投资基金、财通资管现金聚财货币市场基金和财通资管鑫管家货币市场基金基金经理。</p> | 2022-06-21 | - | 7 | <p>硕士研究生学历、硕士学位。2016年3月加入财通证券资产管理有限公司，曾任固收公募投资部研究员、固收公募投资部基金经理助理，现任固收公募投资部基金经理。</p> |

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

从基本面上看，随着前期出台的宏观调控政策逐步发力显效，四季度经济延续波浪式发展态势，生产端稳中有升，但仍面临有效需求不足、预期偏弱等挑战。生产供给回升，11月份全国规模以上工业增加值同比增长6.6%，比上月加快2.0个百分点；服务业生产指数同比增长9.3%，比上月加快1.6个百分点。11月CPI和PPI同比和环比增速均有所下行，其中CPI同比和环比均下降0.5%，PPI同比和环比分别下降3.0%和0.3%，核心CPI同比上涨0.6%。11月，社会融资规模增量为2.45万亿元，比上年同期多4556亿元，社会融资规模存量同比增长9.4%，M2同比增长10%，M1同比增长1.3%。10月到12月制造业采购经理指数（PMI）分别为49.5%、49.4%和49%，连续3个月在临界点以下，其中生产指数仍在临界点以上，新订单指数连续3个月在临界点以下。

政策方面，12月召开的政治局会议强调要坚持稳中求进、以进促稳、先立后破，强化宏观政策逆周期和跨周期调节，积极的财政政策要适度加力、提质增效，稳健的货币政策要灵活适度、精准有效。11月和12月MLF分别超量续作6000亿元和8000亿元。继9月初宣布“认房不认贷”后，京沪两地再次同步降低购房门槛，降低首付比例，调整普

通住宅认定标准。12月，国有大行和股份制银行在年内第三次集中下调存款利率，此举有助于改善银行净息差。

海外方面，美联储在11月初的议息会议上维持联邦基金利率不变，并于12月的议息会议上确认加息结束，并启动降息的讨论。受此影响，美元指数从10月份超106的高点回落至年底的101附近，人民币兑美元汇率由7.3一度升至7.1附近，中间价由7.17调至年底的7.08，汇率对货币政策的掣肘有所缓解。

本基金在报告期内采取中短久期、票息和杠杆策略，配置了优质高性价比的城投债，以提高组合的静态收益，并适当配置逆回购，辅以利率债、高评级信用债、高评级国股存单等的波段操作，在保证流动性的前提下增厚产品收益，力争为投资人创造长期稳健的投资回报。

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1.2155元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.78%，同期业绩比较基准收益率为0.82%；截至报告期末财通资管鸿达债券C基金份额净值为1.1936元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.70%，同期业绩比较基准收益率为0.82%；截至报告期末财通资管鸿达债券E基金份额净值为1.1977元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.75%，同期业绩比较基准收益率为0.82%；截至报告期末财通资管鸿达债券I基金份额净值为1.0822元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.69%，同期业绩比较基准收益率为0.82%。

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 | 7,650,643,651.27 | 88.42 |
| | 其中：债券 | 7,620,395,851.27 | 88.07 |
| | 资产支持证券 | 30,247,800.00 | 0.35 |
| 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 | 984,740,064.77 | 11.38 |
| 8 | 其他资产 | 17,721,006.17 | 0.20 |
| 9 | 合计 | 8,653,104,722.21 | 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 | 2,247,765,553.75 | 31.52 |
| | 其中：政策性金融债 | 975,122,131.02 | 13.67 |
| 4 | 企业债券 | 799,661,477.40 | 11.21 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,810,283,012.90 | 25.39 |
| 6 | 中期票据 | 2,196,840,887.53 | 30.81 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 565,599,509.47 | 7.93 |
| 9 | 其他 | 245,410.22 | 0.00 |
| 10 | 合计 | 7,620,395,851.27 | 106.86 |

注：其他为地方政府债。

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 | 1928006 | 19工商银行二级01 | 2,800,000 | 290,180,340.98 | 4.07 |
| 2 | 220208 | 22国开08 | 2,600,000 | 265,908,748.63 | 3.73 |
| 3 | 112303075 | 23农业银行CD075 | 2,000,000 | 198,393,938.80 | 2.78 |
| 4 | 1928004 | 19农业银行二级02 | 1,900,000 | 197,038,160.66 | 2.76 |
| 5 | 190208 | 19国开08 | 1,900,000 | 194,389,000.00 | 2.73 |

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 | 169416 | 惠发04 | 300,000 | 30,247,800.00 | 0.42 |

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会上海监管局、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 | 13,335.39 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 17,707,670.78 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 17,721,006.17 |

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

| | 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 | 财通资管鸿达 债券I |
|-----------------------------------|--------------------|---------------|----------------------|---------------|
| 报告期期初基金份 额总额 | 401,122,956.0 1 | 31,016,941.61 | 5,519,781,163. 45 | 39,728,277.62 |
| 报告期期间基金总 申购份额 | 426,556,903.5 6 | 3,840,377.83 | 510,409,221.6 1 | 1,192,399.20 |
| 减：报告期期间基 金总赎回份额 | 383,836,636.0 7 | 6,490,747.36 | 563,991,865.2 0 | 31,213,759.76 |
| 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 | 443,843,223.5 0 | 28,366,572.08 | 5,466,198,519. 86 | 9,706,917.06 |

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

本报告期，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

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层

浙江省杭州市上城区新业路300号中国人寿大厦2幢22层

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：400-116-7888

公司网址：www.ctzg.com

财通证券资产管理有限公司

2024年01月22日