
财通资管睿盈债券型证券投资基金

2023年第3季度报告

2023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:浙商银行股份有限公司

报告送出日期:2023年10月25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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月23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	财通资管睿盈债券	
基金主代码	015818	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年11月07日	
报告期末基金份额总额	1,719,157,424.91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、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	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	财通资管睿盈债券A	财通资管睿盈债券C
下属分级基金的交易代码	015818	015819
报告期末下属分级基金的份额总额	1,719,154,383.87份	3,041.04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(2023年07月01日 - 2023年09月30日)	
	财通资管睿盈债券A	财通资管睿盈债券C
1.本期已实现收益	10,509,031.49	14.94
2.本期利润	7,798,996.18	10.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0037	0.0032
4.期末基金资产净值	1,758,736,404.36	3,108.42
5.期末基金份额净值	1.0230	1.0222

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

财通资管睿盈债券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	0.34%	0.06%	0.01%	0.05%	0.33%	0.01%
过去六个月	1.37%	0.05%	0.95%	0.04%	0.42%	0.01%
自基金合同生效起至今	2.30%	0.05%	0.39%	0.05%	1.91%	0.00%

财通资管睿盈债券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	0.32%	0.06%	0.01%	0.05%	0.31%	0.01%

过去六个月	1.33%	0.05%	0.95%	0.04%	0.38%	0.01%
自基金合同生效起至今	2.22%	0.05%	0.39%	0.05%	1.83%	0.00%

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

财通资管睿盈债券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

(2022年11月07日-2023年09月30日)



财通资管睿盈债券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

(2022年11月07日-2023年09月30日)



注：1、本基金合同于 2022 年 11 月 07 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的 6 个月，报告期末本基金已建仓完毕，截至建仓期结束，各项资产配置比例符合本基金基金合同约定。

§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		
毛飞	本基金基金经理、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、财通资管中债1-3年国开行债券指数证券投资基金、财通资管睿安债券型证券投资基金和财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。	2023-01-04	-	1	博士研究生学历、硕士学位。曾在美国联邦储备银行圣路易分局、英国经济学人智库、上海浦东发展银行、中原银行股份有限公司工作。2022年5月加入财通证券资产管理有限公司，现任固收公募投资部固收公募投资副总监。
邹舟	本基金基金经理。	2022-11-07	2023-08-01	7	硕士研究生学历、硕士学位。曾在中审亚太会计师事务所海南分所、永生实业投资有限公司、外滩控股集团工作。2016年4月加入财通证券资产管理有限公司，曾任固收公募投资部基金经理助理、固收公募投资部基金经理。

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《财通资管睿盈债券型证券投资基金基金合同》、《财通资管睿盈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，三季度随着各项政策逐步落地，经济指标有所改善。8月PMI环比修复，制造业PMI回升0.4个点至49.7%，新订单PMI环比上升至50.2%，内需整体贡献高于外需。8月CPI和PPI增速双双上行，其中CPI同比转正至0.1%，PPI同比回升至-3.0%，反映出经济运行的边际修复。8月社会融资新增3.12万亿元，同比多增0.65万亿元，存量社融增速9.0%，环比上升0.1%，显现见底企稳。8月末，M2余额286.93万亿元，同比增长10.6%，M1余额67.96万亿元，同比增长2.2%，M0余额10.65万亿元，同比增长9.5%。从9月份各项高频数据来看，工厂生产、建筑施工、房地产销售均呈现弱修复，服务业降温、出口环比仍偏弱。同时，随着房地产政策的加码，二手房市场出现转暖迹象，叠加房贷利率调整，有望带来居民中长期信贷增长改观。

政策方面，7月下旬召开的中央政治局会议指出，当前我国经济运行面临新的困难挑战，要精准有力实施宏观调控，加强逆周期调节和政策储备。财政政策方面，8月财政赤字同比明显回升，地方专项债发行节奏加快。货币政策方面，8月15日，央行宣布降息，7天逆回购利率降10bp，MLF利率降15bp，超市场预期。8月下旬开始，房地产优化政策密集出台，以及特殊再融资债券可能发行用于置换地方隐债，这给债市带来利空扰动。随着这些政策调整效果的逐步显现，下半年我国经济有望呈现温和上升态势。

海外方面，美国9月非农就业人口增加33.6万人，增幅创今年以来最大，高于预期值17万人。就业市场的活力暗示企业对销售前景依然充满信心，但也令通胀继续面临上行压力。美国经济数据表现良好，叠加美联储加息会议释放维持高利率信号，对人民币汇率形成压力。随着后续稳经济政策进一步落地实施，预计国内经济将维持稳中向好的修复态势，后续对人民币的支撑或逐渐增强，同时央行和外管局启用稳汇率工具保障汇率在合理区间内稳定运行。

本基金主要以持有政策性金融债、商业银行金融债为主，报告期本基金久期适度伸缩，并抓住交易机会进行部分利率债和高流动性银行金融债的波段操作，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盈债券A基金份额净值为1.0230元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.34%，同期业绩比较基准收益率为0.01%；截至报告期末财通资管睿盈债券C基金份额净值为1.0222元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.32%，同期业绩比较基准收益率为0.01%。

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	1,894,998,319.59	91.56
	其中：债券	1,894,998,319.59	91.56
	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	173,466,360.95	8.38
8	其他资产	1,200,000.00	0.06
9	合计	2,069,664,680.54	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	79,433,981.31	4.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,815,564,338.28	103.23
	其中：政策性金融债	296,293,669.39	16.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,894,998,319.59	107.75

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	220203	22国开03	1,200,000	122,436,000.00	6.96
2	2228057	22浦发银行04	1,200,000	122,039,802.74	6.94

3	2328009	23中信银行01	1,200,000	121,749,816.99	6.92
4	2228032	22建设银行绿色金融债01	1,200,000	121,035,737.70	6.88
5	2220024	22江苏银行小微债	1,000,000	102,047,497.27	5.80

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

本基金的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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司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。上海浦东发展银行股份有限公司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上海监管局、中国银行间市场交易商协会的处罚。江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融

监督管理总局江苏监管局、中国人民银行、中国银行间市场交易商协会、中国证券监督管理委员会江苏监管局的处罚。平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局常州监管分局、中国人民银行、中国银行间市场交易商协会的处罚。兴业银行股份有限公司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上海监管局、中国证券监督管理委员会福建监管局、中国银行间市场交易商协会的处罚。宁波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宁波市分局、中国银行保险监督管理委员会宁波监管局的处罚。交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会的处罚。

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	应收证券清算款	1,200,000.00
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	1,200,000.00

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

	财通资管睿盈债券A	财通资管睿盈债券C
报告期期初基金份额总额	2,537,925,559.91	3,221.04
报告期期间基金总申购份额	312,444,718.83	-
减：报告期期间基金总赎回份额	1,131,215,894.87	180.00
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	1,719,154,383.87	3,041.04

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

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	20230719-20230930	491,689,448.32	-	-	491,689,448.32	28.60%
	2	20230701-20230726	747,662,803.74	-	747,662,803.74	-	0.00%
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内，2023年8月4日，胡珍珍同志离任本基金管理人财务负责人，由钱慧同志代任财务负责人。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、财通资管睿盈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、财通资管睿盈债券型证券投资基金托管协议
- 4、财通资管睿盈债券型证券投资基金基金合同
- 5、财通资管睿盈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

2023年10月25日