
财通资管通达稳健3个月持有期债券型发起式基金中基金
(FOF)

2024年第2季度报告

2024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:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月19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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年07月16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2024年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF） |
| 基金主代码 | 016080 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022年08月10日 |
| 报告期末基金份额总额 | 48,582,860.14份 |
| 投资目标 | 本基金在控制风险的前提下，通过资产配置策略和公募基金精选策略，力争为持有人提供长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 1、大类资产配置策略；2、基金投资策略；3、股票投资策略；4、债券投资策略；5、可转换债券和可交换债券投资策略；6、资产支持证券投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数（全价）收益率×90%+沪深300指数收益率×10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金中基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金和货币型基金中基金，低于混合型基金、混合型基金中基金、股票型基金和股票型基金中基金。 |
| 基金管理人 | 财通证券资产管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 |

| | | |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| 下属分级基金的基金简称 | 财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）A | 财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 016080 | 016081 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 39,681,757.78份 | 8,901,102.36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(2024年04月01日 - 2024年06月30日) | |
|----------------|--------------------------------|--------------------------|
| | 财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）A | 财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）C |
| 1.本期已实现收益 | 873,672.22 | 196,777.63 |
| 2.本期利润 | 502,344.88 | 110,342.27 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0128 | 0.0120 |
| 4.期末基金资产净值 | 42,492,494.55 | 9,486,324.76 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0708 | 1.0657 |

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

财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）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 | 1.21% | 0.03% | 0.75% | 0.07% | 0.46% | -0.04% |
| 过去六个月 | 2.33% | 0.03% | 2.31% | 0.09% | 0.02% | -0.06% |
| 过去一年 | 3.79% | 0.03% | 1.96% | 0.09% | 1.83% | -0.06% |

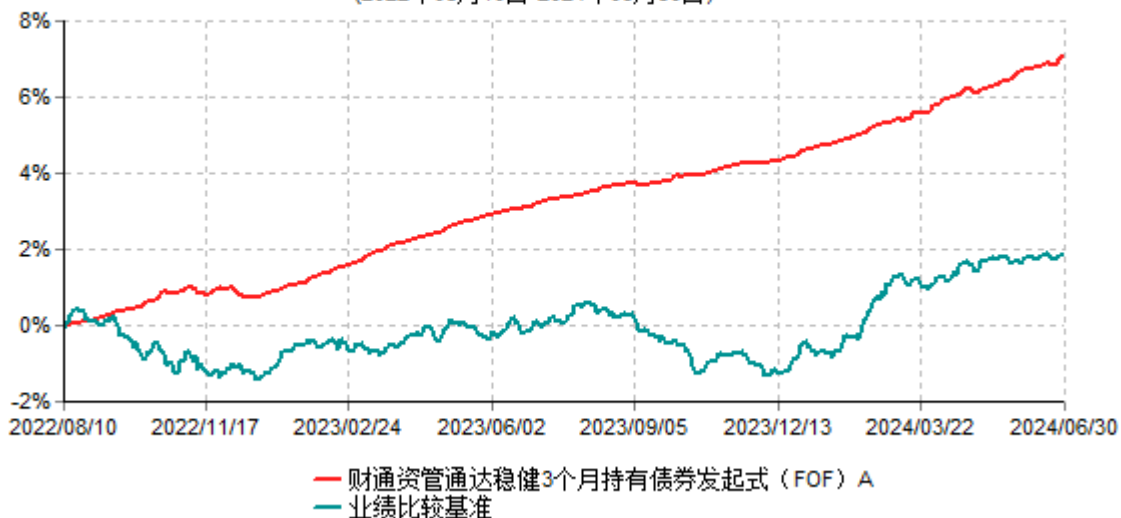
| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 7.08% | 0.03% | 1.88% | 0.10% | 5.20% | -0.07% |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|

财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）C净值表现

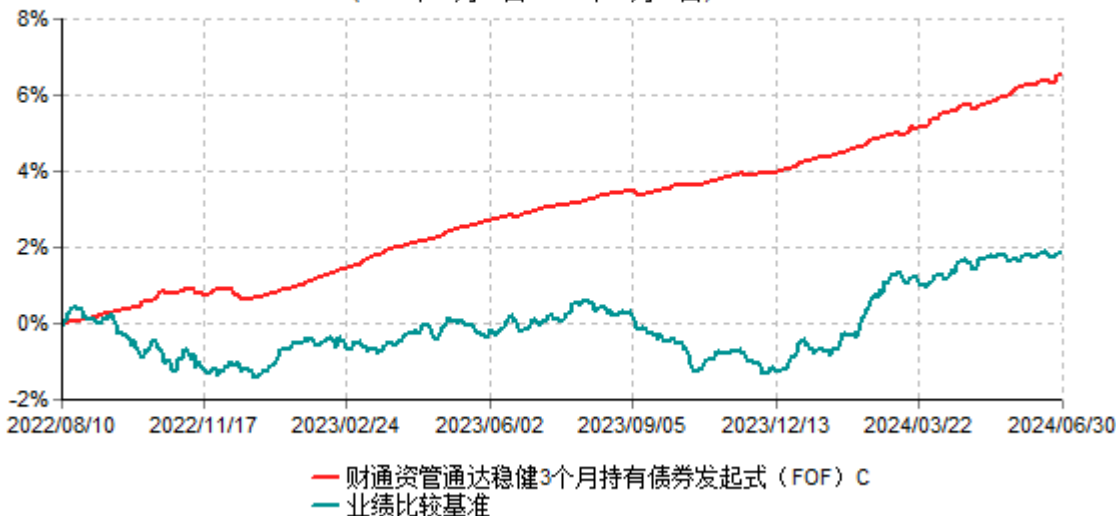
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 1.14% | 0.03% | 0.75% | 0.07% | 0.39% | -0.04% |
| 过去六个月 | 2.20% | 0.03% | 2.31% | 0.09% | -0.11% | -0.06% |
| 过去一年 | 3.54% | 0.03% | 1.96% | 0.09% | 1.58% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.57% | 0.02% | 1.88% | 0.10% | 4.69% | -0.08% |

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

财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）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08月10日-2024年06月30日)



财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）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08月10日-2024年06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 | | |
| 康研 | 本基金基金经理、财通资管通达未来6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）和财通资管通达稳利3个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金经理。 | 2022-08-10 | - | 6 | 博士研究生学历、博士学位。2017年8月加入财通证券资产管理有限公司，曾任指数和策略投资部研究助理、固收私募投资部投资经理助理，现任FOF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《财通资管通达稳健3个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同》、《财通资管通达稳健3个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）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

二季度海外经济边际上有所放缓，但美国财政维持扩张态势，美联储降息预期仍是有所反复，对汇率上的压力不减。国内市场在二季度的CPI和PPI还处于修复过程当中，需求端仍是偏弱。债券市场在4月份消化完超长债供给和地产宽松的预期扰动后，以及“手工补息”被禁止等政策背景下，收益率继续下行。权益市场在二季度则呈现先上后下走势，结构上分化明显。“国九条”推出后市场风格明显偏向大盘价值。在北上资金短暂助推下，五月中旬市场在指数层面到达高点后情绪开始转弱，在一季度表现亮眼的红利类也出现一定分化。预计三季度经济基本面整体上或保持平稳，政策加码的概率仍存。债市在当前低利率水平下，任何扰动都可能造成收益率波动，但“资产荒”的大逻辑犹在，收益率不具备大幅上行基础；权益市场大概率仍是在结构上继续轮动分化。

在当前偏低利率环境下，基金的持仓结构有所调整。在4月份债市小幅上行期间拉长组合久期，并开始少量参与宽基股指配置，尝试捕捉一些权益市场的上涨机会。三季度伊始拟暂时维持组合各类资产配比，静待重要会议之后是否有超预期政策落地。未来会关注红利、出海和新质生产力相关板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）A基金份额净值为1.0708元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.21%，同期业绩比较基准收益率为0.75%；截至报告期末财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）C基金份额净值为1.0657元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.14%，同期业绩比较基准收益率为0.75%。

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 | 44,159,367.50 | 84.23 |
| 3 | 固定收益投资 | 2,724,281.23 | 5.20 |
| | 其中：债券 | 2,724,281.23 | 5.20 |
| | 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 | 591,967.85 | 1.13 |
| 8 | 其他资产 | 4,949,266.40 | 9.44 |
| 9 | 合计 | 52,424,882.98 | 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 | 2,724,281.23 | 5.24 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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 | 2,724,281.23 | 5.24 |

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 | 019631 | 20国债05 | 18,000 | 1,813,725.37 | 3.49 |
| 2 | 019733 | 24国债02 | 7,000 | 707,511.48 | 1.36 |
| 3 | 019727 | 23国债24 | 1,000 | 101,819.04 | 0.20 |
| 4 | 019698 | 23国债05 | 1,000 | 101,225.34 | 0.19 |

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金投资范围未包含国债期货。

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 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 | 2,087.27 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,878,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 66,709.57 |
| 6 | 其他应收款 | 2,469.56 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 4,949,266.40 |

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，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 基金中基金

6.1 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基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额 (份) | 公允价值 (元) | 占基金 资产净 值比例 (%) | 是否属 于基金 管理人 及管理 人关联 方所管 理的基 金 |
|----|--------|-------------------------|--------|--------------|--------------|--------------------------|--|
| 1 | 014484 | 汇添富中债1-3年隐含评级AA+及以上信用债A | 契约型开放式 | 7,131,137.19 | 7,733,718.28 | 14.88 | 否 |
| 2 | 006542 | 财通资管鸿利中短债A | 契约型开放式 | 6,870,197.75 | 7,509,813.16 | 14.45 | 是 |
| 3 | 511520 | 政金债 | 交易型开放式 | 49,700.00 | 5,437,329.10 | 10.46 | 否 |
| 4 | 011062 | 广发7-10年国开行E | 契约型开放式 | 4,087,129.16 | 5,145,695.61 | 9.90 | 否 |
| 5 | 014741 | 财通资管鸿商中短债C | 契约型开放式 | 4,419,932.77 | 4,757,173.64 | 9.15 | 是 |
| 6 | 007916 | 财通资管鸿福短债C | 契约型开放式 | 3,919,165.79 | 4,543,488.90 | 8.74 | 是 |
| 7 | 013449 | 广发景宁纯债C | 契约型开放式 | 3,220,150.47 | 3,692,868.56 | 7.10 | 否 |
| 8 | 017123 | 景顺长城景泰臻利纯债A | 契约型开放式 | 3,064,905.50 | 3,209,569.04 | 6.17 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|--------------|--------|------------|--------------|------|---|
| 9 | 510300 | 300ETF | 交易型开放式 | 343,700.00 | 1,198,481.90 | 2.31 | 否 |
| 10 | 007995 | 华夏中证500指数增强C | 契约型开放式 | 578,654.89 | 931,229.31 | 1.79 | 否 |

6.1.1 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公开募集基础设施证券投资基金投资明细

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用2024年04月01日至 2024年06月30日 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | 1,886.42 | - |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | 396.56 | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 15,407.09 | 11,855.28 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 31,127.64 | 25,626.84 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 6,990.60 | 5,246.30 |
| 当期交易所交易基金产生的交易费（元） | 63.25 | - |

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售

服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金持有的基金报告期内未发生重大影响事件。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

| | 财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）A | 财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）C |
|---------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 38,213,108.19 | 8,730,983.79 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,756,035.01 | 2,631,905.29 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,287,385.42 | 2,461,786.72 |
| 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 | 39,681,757.78 | 8,901,102.36 |

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | 财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）A | 财通资管通达稳健3个月持有债券发起式（FOF）C |
|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 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（%） | 20.58 | - |

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§9 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 | 20.58% | 10,000,200.02 | 20.58% | 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 | 30,365.68 | 0.06% | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,030,565.70 | 20.65% | 10,000,200.02 | 20.58% | - |

§10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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 | 20240401-20240630 | 10,000,200.02 | - | - | 10,000,200.02 | 20.58% |
| 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。 | | | | | | | |

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内，经本基金管理人第三届董事会2023年度会议审议通过并按规定备案，周志远先生自2024年04月30日起担任总经理助理。

2、报告期内，本基金管理人北京分公司住所于2024年06月19日变更至北京市西城区金融大街甲9号楼8层801-01单元。

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、财通资管通达稳健3个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）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、财通资管通达稳健3个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）托管协议
- 4、财通资管通达稳健3个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同
- 5、财通资管通达稳健3个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）招募说明书
- 6、本报告期内按照规定披露的各项公告

11.2 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

11.3 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07月19日