财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 5
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 6
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 39
7.6 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 40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 40
7.8 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贵金属投资明细 40
7.9 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 40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 40

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 40
7.12 投资组合报告附注 41
§8 基金份额持有人信息 42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 42
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 43
§9 开放式基金份额变动 43
§10 重大事件揭示 43
10.1 基金份额持有人大会决议 43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 44
10.4 基金投资策略的改变 44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 44
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 44
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 44
10.8 其他重大事件 46
§11 影响投资者决策的其他重要信息 48
11.1 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 48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 48
§12 备查文件目录 49
12.1 备查文件目录 49
12.2 存放地点 49
12.3 查阅方式 49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	财通资管睿达一年定开债券发起式
基金主代码	015330
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2022 年 05 月 11 日
基金管理人	财通证券资产管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,139,687,816.22 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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、可转换债券和可交换债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、国债期货投资策略；6、开放期投资策略。
业绩比较基准	中债综合指数（全价）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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		财通证券资产管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋巍峰	冯萌
	联系电话	0571-89720101	021-52629999-213310
	电子邮箱	jiangwf@ctzg.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-116-7888	95561
传真		021-68753502	021-62159217
注册地址		浙江省杭州市上城区白云路 26 号 143 室	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		上海市浦东新区栖霞路 26 弄富汇大厦 B 座 8、9 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		200122	200120
法定代表人		马晓立	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ctzg.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通证券资产管理有限公司	浙江省杭州市上城区新业路 300 号中国人寿大厦 2 幢 22 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	10,526,216.53
本期利润	36,765,043.38
加权平均基金份额本期利润	0.0172
本期加权平均净值利润率	1.68%
本期基金份额净值增长率	1.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	50,675,453.91
期末可供分配基金份额利润	0.0237
期末基金资产净值	2,190,363,270.13
期末基金份额净值	1.0237
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	15.29%

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、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%	0.62%	0.04%	0.22%	-0.02%
过去六个月	1.70%	0.02%	0.91%	0.04%	0.79%	-0.02%
过去一年	1.97%	0.04%	-0.56%	0.06%	2.53%	-0.02%
过去三年	10.83%	0.07%	5.12%	0.08%	5.71%	-0.01%
自基金合同生效起至今	15.29%	0.07%	6.47%	0.07%	8.82%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

财通证券资产管理有限公司系财通证券股份有限公司的全资子公司，注册资本 5 亿元人民币。2015 年 12 月，公司获准开展公开募集证券投资基金管理业务。截至 2026 年 06 月 30 日，公司共管理 74 只基金，分别为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、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金、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、财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金、财通资管鑫盛 6 个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管瑞享 12 个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管鸿睿 12 个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿益中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金、财通资管价值成长混合型证券投资基金、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金、财通资管价值发现混合型证券投资基金、财通资管行业精选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、财通资管科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、财通资管丰乾 39 个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金、财通资管均衡价值一年持有期混合型证券投资基金、财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金、财通资管睿慧 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管价值精选一年持有期混合型证券投资基金、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、财通资管消费升级一年持有期混合型证券投资基金、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、财通资管中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、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、财通资管双盈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、财通资管健康产业混合型证券投资基金、财通资管鸿佳 60 天滚动持有中短债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、财通资管稳兴增益六个月持有期混合型证券投资基金、财通资管鸿商中短债债券型证券投资基金、财通资管双福 9 个月持有期债券型发起式证券投资基金、财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管稳兴丰益六个月持有期混合型证券投资基金、财通资管鸿慧中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管通达稳健 3 个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）、财通资管睿盈债券型证券投资基金、财通资管均衡臻选混合型证券投资基金、财通资管双安债券型证券投资基金、财通资管数字经济混合型发起式证券投资基金、财通资管现金聚财货币市场基金、财通资管臻享成长混合型证券投资基金、财通资管睿兴债券型证券投资基金、财通资管品质消费混合型发起式证券投资基金、财通资管睿安债券型证券投资基金、财通资管医疗保健混合型证券投资基金、财通资管康恒平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、财通资管鸿兴 60 天持有期债券型证券投资基金、财通资管双鑫一年持有期债券型证券投资基金、财通资管产业优选混合型发起式证券投资基金、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）、财通资管创新医药混合型证券投资基金、财通资管创新成长混合型证券投资基金、财通资管中证 1000 指数增强型证券投资基金、财通资管康泽稳健养老目标一年持有期混

合型基金中基金（FOF）、财通资管睿丰债券型证券投资基金、财通资管先进制造混合型发起式证券投资基金、财通资管中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、财通资管鸿曜 90 天持有期债券型证券投资基金、财通资管通达稳鑫 3 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、财通资管中证 500 指数增强型证券投资基金、财通资管优质研选混合型发起式证券投资基金、财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金、财通资管周期研选混合型发起式证券投资基金、财通资管消费研选混合型发起式证券投资基金、财通资管双泰债券型证券投资基金和财通资管科技研选混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、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、财通资管鸿睿 12 个月定期开放债券型证券投资基金、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和财通资管瑞享 12 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。	2024 年 06 月 04 日	-	15	本科学历、学士学位。曾在日信证券有限责任公司、财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。
金御	本基金基金经理、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金、财通资管丰乾 39 个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿享 30 天	2026 年 03 月 06 日	-	3	硕士研究生学历、硕士学位。曾在洛阳银行股份有限公司、中原银行股份有限公司工作。2023 年 2 月加入财通证券资产管理有限公司，曾任固收公募投资

	滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管睿慧 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管睿盈债券型证券投资基金、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和财通资管新聚益 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金经理。				部基金经理助理、固收公募投资部基金经理，现任固收多策略公募投资部基金经理。
王珊	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、财通资管鸿兴 60 天持有期债券型证券投资基金、财通资管现金聚财货币市场基金、财通资管鑫管家货币市场基金和财通资管中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。	2026 年 06 月 02 日	-	10	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。
祁昊	本基金基金经理助理、财通资管鸿睿 12 个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管睿安债券型证券投资基金、财通资管睿丰债券型证券投资基金、财通资管睿兴债券型证券投资基金、财通资管双安债券型证券投资基金、财通资管双福 9 个月持有期债券型发起式	2024 年 06 月 21 日	-	9	硕士研究生学历、硕士学位。曾在华泰资产管理有限公司工作。2019 年 4 月加入财通证券资产管理有限公司，曾任交易部交易员、固收公募投资部基金经理助理，现任固收多策略公募投资部基金经理助理。

	证券投资基金、财通资管稳兴增益六个月持有期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和财通资管中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理助理。				
姚一东	本基金基金经理助理、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金、财通资管丰乾 39 个月定期开放债券型证券投资基金、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、财通资管睿安债券型证券投资基金、财通资管睿慧 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管睿盈债券型证券投资基金、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、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、财通资管鑫盛 6 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和财通资管中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理助理。	2025 年 04 月 02 日	2026 年 05 月 12 日	5	硕士研究生学历、硕士学位。曾在工商银行上海市分行工作。2020 年 10 月加入财通证券资产管理有限公司，现任固收多策略公募投资部基金经理助理。

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。

3、2026 年 7 月 22 日解除陈希希本基金基金经理的职务。

4.1.3 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遵规守信情况的说明

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《财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》、《财通资管睿达一年定期开放债券型发起式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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在出口较快增长、工业生产保持韧性、以旧换新等扩内需政策持续落地以及结构性金融支持靠前发力等支撑下，一季度国内生产总值同比增长 5.0%，二季度受外需扰动与结构转型等因素影响增

速回落至 4.3%，上半年整体同比增长 4.7%，与全年“5%左右”的预期目标基本相符。新旧动能转换继续推进，而内外需平衡与传统领域调整压力仍待进一步消化，具体来看：上半年对外贸易增势较强，货物贸易进出口同比增长 16.9%，其中出口增长 13.4%，进口增长 22.1%，机电产品出口、对共建“一带一路”国家贸易等结构优化特征明显。工业生产较快增长，规模以上工业增加值同比增长 5.4%，装备制造业、高技术制造业增加值分别增长 9.3%、13.3%，分别快于全部规上工业 3.9 个和 7.9 个百分点。投资端表现偏弱，固定资产投资（不含农户）同比下降 5.7%，基础设施投资下降 2.4%，制造业投资下降 1.2%，但高技术产业投资仍增长 4.6%；地产周期下行持续压制相关需求，房地产开发投资下降 18.0%，新建商品房销售面积、销售额分别下降 11.6%、13.6%。消费市场整体缓慢扩容，社会消费品零售总额同比增长 1.3%，服务零售额增长 5.3%，实物消费修复仍需巩固。从货币政策来看，上半年在稳增长、稳汇率与防风险前提下继续实施适度宽松的货币政策，总量工具运用相对克制、更重结构发力：1 月起下调各类结构性货币政策工具利率 0.25 个百分点，并将再贷款、再贴现利率同步下调 0.25 个百分点，同时增量和优化支农支小、科技创新和技术改造再贷款等工具额度，引导重点领域信贷投放；公开市场操作与国债买卖等灵活搭配，保持流动性充裕，社会综合融资成本处于较低水平，1 年期、5 年期以上 LPR 分别维持在 3.0%、3.5%。回顾上半年债券市场，整体呈震荡整理、收益率中枢小幅下行的走势，10 年期国债到期收益率（中债）大致在 1.70%—1.90%区间内波动，年初约 1.84%，阶段高点接近 1.90%，6 月上旬一度下探至约 1.70%附近，6 月末收在 1.73%左右，较年初有所下行。

本基金根据市场情况灵活调整久期与持仓结构。在挖掘收益率曲线凸点，做好骑乘策略、杠杆策略的基础上，积极参与波段交易，通过资本利得增厚产品收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末财通资管睿达一年定开债券发起式份额净值为 1.0237 元，本报告期财通资管睿达一年定开债券发起式份额净值增长率为 1.70%，同期业绩比较基准收益率为 0.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我国仍面临外部环境的较高不确定性，外需景气与地缘、贸易政策扰动仍需密切跟踪，地产调整及其对投资、地方财政和上下游需求的制约或仍将延续，基本面修复斜率偏缓和结构分化或继续对债市形成支撑。海外方面，主要经济体通胀与增长路径仍存分化，市场对美联储年内降息时点与幅度预期并不一致，更多关注点或集中在下半年后半段及更远窗口；若外部货币政策约束边际缓和，国内总量与结构工具的配合空间有望进一步打开，但仍将统筹稳增长、物价、汇率

与金融机构稳健性。总体来看，下半年债券收益率出现大幅持续上行的可能性相对有限，曲线形态与波动或更多反映资金面、供给节奏与政策预期的再定价。后续将重点关注海外政策与风险溢价变化，以及我国基本面、政策面和资金面的边际变化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人设有估值工作小组，估值工作小组成员由公司研究及投资部门、合规稽核部、风险管理部、运营保障部等人员组成。估值小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据及预期信用损失数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金每 10 份基金份额发放红利 0.18 元人民币，共计分配收益 38,514,381.02 元，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金

合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金
报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,710,784.62	2,467,119.11
结算备付金		527,713.01	524,084.44
存出保证金		6,884.10	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,722,206,257.44	2,748,184,317.17
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,722,206,257.44	2,748,184,317.17
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,725,451,639.17	2,751,175,520.72
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 06 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		534,057,030.08	557,942,832.90
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		539,684.41	558,303.51
应付托管费		179,894.80	186,101.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		164,125.60	142,200.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	147,634.15	233,489.62
负债合计		535,088,369.04	559,062,927.71
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,139,687,816.22	2,139,687,801.46
未分配利润	6.4.7.8	50,675,453.91	52,424,791.55
净资产合计		2,190,363,270.13	2,192,112,593.01
负债和净资产总计		2,725,451,639.17	2,751,175,520.72

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0237 元，基金份额总额 2,139,687,816.22 份。

6.2 利润表

会计主体：财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金
本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	**附注号**	**本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日**	**上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日**
一、营业总收入		45,882,790.65	28,670,048.38
1.利息收入		16,701.13	19,357.36

其中：存款利息收入	6.4.7.9	16,701.13	19,357.36
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,627,262.67	48,738,208.06
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	19,627,262.67	48,738,208.06
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	26,238,826.85	-20,087,517.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-	-
减：二、营业总支出		9,117,747.27	11,991,755.69
1．管理人报酬		3,254,258.61	4,441,564.73
2．托管费		1,084,752.87	1,480,521.64
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		4,569,300.10	5,858,253.63
其中：卖出回购金融资产支出		4,569,300.10	5,858,253.63
6．信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7．税金及附加		91,782.53	96,198.20
8．其他费用	6.4.7.17	117,653.16	115,217.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		36,765,043.38	16,678,292.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36,765,043.38	16,678,292.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		36,765,043.38	16,678,292.69

6.3 净资产变动表

会计主体：财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金
本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,139,687,801.46	52,424,791.55	2,192,112,593.01

二、本期期初净资产	2,139,687,801.46	52,424,791.55	2,192,112,593.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	14.76	-1,749,337.64	-1,749,322.88
（一）、综合收益总额	-	36,765,043.38	36,765,043.38
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	14.76	-	14.76
其中：1.基金申购款	14.76	-	14.76
2.基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-38,514,381.02	-38,514,381.02
四、本期期末净资产	2,139,687,816.22	50,675,453.91	2,190,363,270.13

项目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,939,686,723.46	47,484,390.59	2,987,171,114.05
二、本期期初净资产	2,939,686,723.46	47,484,390.59	2,987,171,114.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,078.00	16,678,314.69	16,679,392.69
（一）、综合收益总额	-	16,678,292.69	16,678,292.69
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,078.00	22.00	1,100.00
其中：1.基金申购款	1,078.00	22.00	1,100.00
2.基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	2,939,687,801.46	64,162,705.28	3,003,850,506.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

钱慧	刘博	刘博
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]360 号《关于准予财通资管睿达一年定期开

放债券型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由财通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、定期开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,009,999,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0361 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 5 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,010,059,200.02 份基金份额，其中认购资金利息折合 60,200.02 份基金份额。本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、政府支持机构债、政府支持债、地方政府债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不直接投资股票，但可持有因可转换债券、可交换债券转股所形成的股票。因上述原因持有的股票，本基金将在其可交易之日起的 10 个工作日内卖出。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。在开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；在封闭期内，本基金不受前述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人财通证券资产管理有限公司于 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号--年度报告和中期报告》以及参考本基金的基金合同和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及其允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部及税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。本基金管理人运

营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3%的征收率计算缴纳增值税。

自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	2,710,784.62
等于：本金	2,710,229.36
加：应计利息	555.26
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	2,710,784.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	102,977,166.30	1,383,278.91	104,116,878.91	-243,566.30
	银行间市场	2,578,324,243.91	23,562,378.53	2,618,089,378.53	16,202,756.09
	合计	2,681,301,410.21	24,945,657.44	2,722,206,257.44	15,959,189.79
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,681,301,410.21	24,945,657.44	2,722,206,257.44	15,959,189.79

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	49,074.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	49,074.00
应付利息	-
预提费用	98,560.15
合计	147,634.15

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,139,687,801.46	2,139,687,801.46
本期申购	14.76	14.76
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,139,687,816.22	2,139,687,816.22

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	887,909,267.40	-835,484,475.85	52,424,791.55
本期期初	887,909,267.40	-835,484,475.85	52,424,791.55
本期利润	10,526,216.53	26,238,826.85	36,765,043.38
本期基金份额交易产生的变动数	5.56	-5.56	-
其中：基金申购款	5.56	-5.56	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-38,514,381.02	-	-38,514,381.02
本期末	859,921,108.47	-809,245,654.56	50,675,453.91

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	12,934.54
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,757.23
其他	9.36
合计	16,701.13

注：其他包括存出保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益--买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益——买卖股票差价收入。

6.4.7.10.2 股票投资收益--证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益--利息收入	31,166,398.02
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-11,539,135.35
债券投资收益--赎回差价收入	-
债券投资收益--申购差价收入	-
合计	19,627,262.67

6.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,552,860,758.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,531,484,003.30
减：应计利息总额	32,869,402.61
减：交易费用	46,487.50
买卖债券差价收入	-11,539,135.35

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.12.2 衍生工具收益--其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.13 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1.交易性金融资产	26,238,826.85
--股票投资	-

--债券投资	26,238,826.85
--资产支持证券投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2.衍生工具	-
--权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	26,238,826.85

6.4.7.15 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	9,793.01
银行间查询服务费	600.00
账户维护费	18,000.00
合计	117,653.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
财通证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
财通证券股份有限公司	基金管理人的控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
财通证券股份有限公司	72,542,606.85	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
财通证券股份有限公司	25,000,000.00	100.00%	80,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,254,258.61	4,441,564.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	971,676.14	1,328,900.01
应支付基金管理人的净管理费	2,282,582.47	3,112,664.72

注：基金管理费按基金前一日的资产净值乘以 0.30%的管理费年费率来计算，具体计算方法如下：

每日应计提基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数。基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,084,752.87	1,480,521.64

注：基金托管费按基金前一日的资产净值乘以 0.10%的托管费年费率来计算，具体计算方法如下：

每日应计提基金托管费=前一日该基金资产净值×年托管费率÷当年天数。基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.47%	0.34%

注：1. 申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。

2. 基金管理人认购/申购/赎回本基金的交易通过财通证券资产管理有限公司直销办理，适用费率参照《财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》以及 2026 年 02 月 24 日发布的《财通证券资产管理有限公司旗下公募基金在直销渠道开展认（申）购费率优惠活动的公告》的收费标准。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末	上年度末

	2026 年 06 月 30 日		2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业银行股份有限公司	2,129,686,523.44	99.53%	2,129,686,523.44	99.53%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	2,710,784.62	12,934.54	2,058,928.15	15,400.41

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2026 年 03 月 13 日	2026 年 03 月 13 日	0.180	38,514,366.26	14.76	38,514,381.02	-
合计			0.180	38,514,366.26	14.76	38,514,381.02	-

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 534,057,030.08 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102482295	24 苏州国际 MTN004	2026 年 07 月 01 日	100.65	500,000	50,322,986.30
102482377	24 两江产业 MTN002(科创票据)	2026 年 07 月 01 日	102.01	500,000	51,003,449.32
102483849	24 金桥集团 MTN002A	2026 年 07 月 01 日	103.84	600,000	62,303,713.97
102484108	24 嘉兴产业 MTN002	2026 年 07 月 01 日	103.79	600,000	62,272,790.14
102484254	24 南航股 MTN009	2026 年 07 月 01 日	102.34	20,000	2,046,834.96
102581120	25 济南能源 MTN001	2026 年 07 月 01 日	103.70	400,000	41,481,238.36
102582275	25 光大控股 MTN001	2026 年 07 月 01 日	100.89	200,000	20,178,904.11
102601813	26 广州高新 MTN001	2026 年 07 月 01 日	101.23	380,000	38,468,222.46
102601816	26 知识城 MTN001	2026 年 07 月 01 日	101.30	1,000,000	101,295,391.78
2380069	23 台州债 01	2026 年 07 月 02 日	104.34	800,000	83,470,557.81

2420020	24 郑州银行绿色债	2026 年 07 月 02 日	100.90	900,000	90,807,904.11
合计				5,900,000	603,651,993.32

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，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。本基金在日常经营活动中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立规范科学有效的内部风险管理体系结构。董事会是公司风险管理的最高决策机构，授权公司经营管理层建立责任明确、程序清晰的组织结构，制定公司风险管理的具体规章制度，组织实施各类风险的识别与评估工作；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，风险管理部负责拟定公司的风险管理政策、风险管理流程和具体制度，并具体实施，确保公司整体风险得到有效的识别、监控和管理，确保公司各项内部管理制度得到有效执行。基金管理业务合规负责人对董事会负责并报告工作，负责监督检查公募基金业务的合法合规性并对内部控制制度的执行情况进行监察、稽核。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	903,863,209.24	888,959,687.72
AAA 以下	71,206,516.71	69,612,596.17
未评级	1,747,136,531.49	1,789,612,033.28
合计	2,722,206,257.44	2,748,184,317.17

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为中期票据、公司债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2026 年 6 月 30 日,除卖出回购金融资产款余额将在一个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	2,710,784.62	-	-	-	2,710,784.62
结算备付金	527,713.01	-	-	-	527,713.01
存出保证金	6,884.10	-	-	-	6,884.10
交易性金融资产	430,658,918.25	2,047,119,460.27	244,427,878.92	-	2,722,206,257.44
资产总计	433,904,299.98	2,047,119,460.27	244,427,878.92	-	2,725,451,639.17
负债					
卖出回购金融资产款	534,057,030.08	-	-	-	534,057,030.08
应付管理人报酬	-	-	-	539,684.41	539,684.41
应付托管费	-	-	-	179,894.80	179,894.80
应交税费	-	-	-	164,125.60	164,125.60
其他负债	-	-	-	147,634.15	147,634.15
负债总计	534,057,030.08	-	-	1,031,338.96	535,088,369.04
利率敏感度缺口	-100,152,730.10	2,047,119,460.27	244,427,878.92	-1,031,338.96	2,190,363,270.13
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,467,119.11	-	-	-	2,467,119.11
结算备付金	524,084.44	-	-	-	524,084.44
交易性金融资产	833,197,695.32	1,548,331,333.14	366,655,288.71	-	2,748,184,317.17
资产总计	836,188,898.87	1,548,331,333.14	366,655,288.71	-	2,751,175,520.72
负债					
卖出回购金融资产款	557,942,832.90	-	-	-	557,942,832.90
应付管理人报酬	-	-	-	558,303.51	558,303.51
应付托管费	-	-	-	186,101.15	186,101.15
应交税费	-	-	-	142,200.53	142,200.53
其他负债	-	-	-	233,489.62	233,489.62
负债总计	557,942,832.90	-	-	1,120,094.81	559,062,927.71
利率敏感度缺口	278,246,065.97	1,548,331,333.14	366,655,288.71	-1,120,094.81	2,192,112,593.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.市场利率下降 25 个基点	15,461,470.59	19,857,825.48
	2.市场利率上升 25 个基点	-15,305,593.96	-19,172,728.58

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末

	2026 年 06 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	2,722,206,257.44	2,748,184,317.17
第三层次	-	-
合计	2,722,206,257.44	2,748,184,317.17

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	2,722,206,257.44	99.88
	其中：债券	2,722,206,257.44	99.88
	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	3,238,497.63	0.12
8	其他各项资产	6,884.10	0.00
9	合计	2,725,451,639.17	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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境内股票。

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未买卖股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	535,627,287.15	24.45
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	187,587,436.72	8.56
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,998,991,533.57	91.26
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,722,206,257.44	124.28

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	102601816	26 知识城 MTN001	1,000,000	101,295,391.78	4.62
2	102483303	24 湖南建设 MTN001	900,000	92,042,753.42	4.20
3	102482282	24 洪市政 MTN004	900,000	91,834,140.82	4.19
4	2420020	24 郑州银行绿色债	900,000	90,807,904.11	4.15
5	2380069	23 台州债 01	800,000	83,470,557.81	3.81

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，郑州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河南省分局、中国人民银行河南省分行的处罚。厦门国际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厦门市分行的处罚。

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票资产。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,884.10
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,884.10

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
202	10,592,513.94	2,139,687,816.22	100.00%	0.00	0.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 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	0.47%	10,000,200.02	0.47%	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	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,200.02	0.47%	10,000,200.02	0.47%	-

注：截至本报告期末，本发起式基金发起资金持有份额已满三年。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 05 月 11 日）基金份额总额	3,010,059,200.02
本报告期期初基金份额总额	2,139,687,801.46
本报告期基金总申购份额	14.76
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,139,687,816.22

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内，经本基金管理人第三届董事会第二十四、二十五次会议审议通过并按规定备案，

自 2026 年 1 月 1 日起邹广航先生担任副总经理兼财务负责人。

2、报告期内，无基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无因基金业务受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无因基金业务受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	2	-	-	-	-	-

长江证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	本报告期退租
华创证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
财通证券	72,542,606.85	100.00%	25,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：公司在综合考虑证券公司内控情况和服务能力等多因素下，选择财务状况良好、经营行为规范、具有较强的合规风控能力和交易、研究等服务能力的证券公司参与证券交易。

a.选择证券公司参与证券交易的标准如下：

1、经营行为规范、财务状况良好；

2、具有较强的合规风控能力，内控制度健全，风险管理机制完善；

3、具备较强的交易服务能力，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，具备成熟、稳定的交易系统；

4、具备较强的研究服务能力，包括但不限于较完整的研究团队配置、较好的研究和行业分析能力、良好的研究服务质量及提供定制化研究服务的能力等。

b.选择证券公司参与证券交易的程序如下：

1、对证券公司的经营情况、财务状况、合规风控能力、交易、研究服务能力等进行初步调查；

2、对于符合公司标准的证券公司，与其沟通证券交易单元租用协议，约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式；

3、经审批后完成相关协议签订，并根据签署协议情况完成信息录入、开户、系统参数设置等；

4、研究服务评价每季度进行一次，评价结果作为季度佣金分配依据。

c.本报告期内本基金退租国盛证券 2 个交易单元，无新增交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	财通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年01月02日
2	财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年01月22日
3	关于财通证券资产管理有限公司旗下公募基金在直销渠道开展认（申）购费率优	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国	2026年02月24日

	惠活动的公告	证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	
4	财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年03月07日
5	财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2026 年第 1 号）	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年03月11日
6	财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年03月11日
7	财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年03月12日
8	财通证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年03月30日
9	财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年03月31日
10	财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2026 年第 2 号）	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年04月20日
11	财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年04月20日
12	财通资管睿达一年定期开放债券型发起	中国证券报、管理人网站	2026年04月22日

	式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	（www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	
13	财通证券资产管理有限公司年度公募基金管理人以股东身份 （通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年04月28日
14	财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年06月03日
15	财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2026 年第 3 号）	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年06月05日
16	财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、管理人网站（www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年06月05日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20260101-20260630	2,129,686,523.44	-	-	2,129,686,523.44	99.53%
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、财通资管睿达一年定期开放债券型发起式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、财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议

4、财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同

5、财通资管睿达一年定期开放债券型发起式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

12.2 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

12.3 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

2026 年 08 月 31 日