

财通资管双盈债券型发起式证券投资基金  
2026 年第 2 季度报告

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：华夏银行股份有限公司  
报告送出日期：2026 年 07 月 21 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

|                 |                                                     |                |
|-----------------|-----------------------------------------------------|----------------|
| 基金简称            | 财通资管双盈债券发起式                                         |                |
| 基金主代码           | 013097                                              |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                                              |                |
| 基金合同生效日         | 2021 年 09 月 24 日                                    |                |
| 报告期末基金份额总额      | 607,211,018.51 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、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、股票投资策略；5、国债期货投资策略。 |                |
| 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          | 本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。          |                |
| 基金管理人           | 财通证券资产管理有限公司                                        |                |
| 基金托管人           | 华夏银行股份有限公司                                          |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 财通资管双盈债券发起式 A                                       | 财通资管双盈债券发起式 C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 013097                                              | 013098         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 600,563,510.92 份                                    | 6,647,507.59 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（2026 年 04 月 01 日-2026 年 06 月 30 日） |               |
|-----------------|----------------------------------------|---------------|
|                 | 财通资管双盈债券发起式 A                          | 财通资管双盈债券发起式 C |
| 1. 本期已实现收益      | 2,064,603.44                           | 28,743.06     |
| 2. 本期利润         | 2,693,481.20                           | 102,443.65    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0048                                 | 0.0085        |
| 4. 期末基金资产净值     | 669,354,074.20                         | 7,269,910.26  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1145                                 | 1.0936        |

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

财通资管双盈债券发起式 A

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 0.44%      | 0.14%         | 1.74%          | 0.14%                     | -1.30% | 0.00% |
| 过去六个月          | 1.03%      | 0.14%         | 1.62%          | 0.12%                     | -0.59% | 0.02% |
| 过去一年           | 5.02%      | 0.14%         | 1.98%          | 0.11%                     | 3.04%  | 0.03% |
| 过去三年           | 6.66%      | 0.17%         | 7.80%          | 0.11%                     | -1.14% | 0.06% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 11.45%     | 0.17%         | 7.74%          | 0.11%                     | 3.71%  | 0.06% |

财通资管双盈债券发起式 C

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|------------|---------------|----------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.34%      | 0.14%         | 1.74%          | 0.14%                     | -1.40% | 0.00% |
| 过去六个月 | 0.84%      | 0.14%         | 1.62%          | 0.12%                     | -0.78% | 0.02% |

|            |       |       |       |       |        |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去一年       | 4.61% | 0.14% | 1.98% | 0.11% | 2.63%  | 0.03% |
| 过去三年       | 5.41% | 0.17% | 7.80% | 0.11% | -2.39% | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.36% | 0.17% | 7.74% | 0.11% | 1.62%  | 0.06% |

### 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



财通资管双盈债券发起式 C



§ 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 |        |                                                                                                                               |
| 石玉山 | 本基金基金经理、财通资管鸿睿 12 个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管瑞享 12 个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管双安债券型证券投资基金、财通资管稳兴增益六个月持有期混合型证券投资基金和财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金经理。 | 2022 年 05 月 05 日 | —    | 8      | 博士研究生学历、博士学位。曾在上海海通证券资产管理有限公司、永赢基金管理有限公司工作。2021 年 7 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、固收多策略公募投资部基金经理，现任固收公募投资部基金经理。 |
| 韩晗  | 本基金基金经理、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管                                                                                             | 2025 年 01 月 22 日 | —    | 11     | 硕士研究生学历、硕士学位。曾在财通证券股份有限公司工作。2014                                                                                              |

|  |                                        |  |  |  |                                                 |
|--|----------------------------------------|--|--|--|-------------------------------------------------|
|  | 鸿商中短债债券型证券投资基金和财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金基金经理。 |  |  |  | 年 12 月加入财通证券资产管理有限公司，曾任固收私募投资部投资经理，现任固收研究部副总经理。 |
|--|----------------------------------------|--|--|--|-------------------------------------------------|

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《财通资管双盈债券型发起式证券投资基金基金合同》、《财通资管双盈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 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。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

从基本面来看，二季度国内经济整体延续修复态势，但内生动能偏弱、结构分化进一步加剧。制造

业景气度总体在荣枯线附近波动，4 月、5 月、6 月制造业 PMI 分别为 50.3%、50.0%、50.3%，虽连续位于扩张区间但回升力度有限，显示制造业修复偏温和；5 月规模以上工业增加值同比增长 4.5%，较 4 月的 4.1%有所回升，生产端保持一定韧性。价格方面，4 月、5 月 CPI 同比均为 1.2%，物价温和低位运行；PPI 同比由 4 月的 2.8%明显回升至 5 月的 3.9%，工业品价格边际改善较为显著。需求侧方面，投资端走弱趋势较为明显，1-5 月固定资产投资累计同比降至-4.1%（4 月为-1.6%，一季度末尚为正增长），其中房地产开发投资降幅持续扩大至-16.2%（4 月-13.7%），民间投资累计同比进一步下探至-7.1%（4 月-5.2%），反映内需与市场主体信心恢复仍面临压力；5 月社会消费品零售总额同比转为-0.6%，消费端修复动能有所回落，居民端需求恢复的基础仍不牢固。

从政策面来看，二季度宏观政策继续保持稳增长与适度宽松取向，货币政策更加强调流动性呵护和向价格型框架转型。总量层面，1 年期 LPR 在二季度连续三个月维持在 3.0%，5 月末社融存量增速 7.7%、M2 同比 8.6%，货币金融环境保持平稳。工具运用上，央行以数量型操作为主发力：6 月加量续作 5000 亿元 1 年期 MLF、开展买断式逆回购操作，并于季末新增隔夜逆回购工具、优化公开市场操作要素，护航跨季资金面。同时，央行明确提出进一步推动货币政策框架向价格型转型，增强短端利率调控的精准性，市场普遍预期数量型工具将成为下半年货币政策适度宽松的主要着力点，后续不排除通过降准等方式补充流动性。整体看政策仍保持托底导向，节奏上更偏平滑与精准发力。

从海外方面来看，二季度外部环境的不确定性进一步上升，海外流动性预期明显收敛。6 月美联储议息会议继续将联邦基金利率维持在 3.50%-3.75%不变，实现连续多次“按兵不动”，且政策措辞转向偏强硬，删除此前的宽松偏向表述。在通胀韧性方面，美国 5 月 PCE 同比涨 4.1%、核心 PCE 同比 3.4%，双双创三年“新高”，通胀压力再度升温；美联储点阵图显示 19 名决策者中有 9 人预计年内至少加息一次，新任主席沃什弱化“降息叙事”、优先对抗通胀，市场对年内降息预期基本消退并转向加息定价。整体而言，海外货币环境较一季度更趋收紧，叠加中东地缘风险对能源价格与通胀路径的扰动，外部不确定性对国内市场的影响仍主要体现在风险偏好、通胀预期和汇率环境等层面。

二季度转债市场整体震荡上行、结构分化明显，中证转债指数季度上涨 3.70%。4 月份权益市场在美伊冲突回撤后迎来集中修复，风险偏好回升驱动高  $\beta$  结构反弹，中证转债当月强势上涨 6.13%，转债领涨于权益、估值一度攀升至历史较高分位，独立行情下透支了部分空间；5 月份权益市场在“十五五”规划与 AI 算力主线驱动下继续上行，转债市场先扬后抑，在中美领导人会晤等事件落地后，权益温和回调而转债剧烈调整，中证转债当月下跌 2.46%，凸显极端估值下的脆弱性；进入 6 月份，AI 拥挤交易使得市场

进入极端分化行情，低价转债承受评级调整压力叠加流动性匮乏领跌于市场，含 AI 量较高的高价转债表现亮眼，中证转债指数小幅收涨 0.17%、估值中枢基本企稳。向后展望，国内宏观经济趋势向好、货币政策维持稳健偏松格局不变，在强盈利预期、产业趋势的支撑下，权益市场“结构性慢牛”格局有望延续。转债市场在资金面转弱驱动下继续消化估值，关注转债的配置性价比提升。择券方面，关注基本面和评级安全边际带来的阿尔法机会，规避高价高溢价率品种。本基金操作上更加注重赔率思维，布局左侧机会，关注估值回归合理区间的优质标的布局窗口。

整体组合层面，我们在组合结构上做了红利与科技成长的再平衡，在市场大幅波动的情形下，有效降低整体波动率。转债方面，我们积极在左侧小仓位布局部分由于负债错杀的优质底仓标的，并根据各类估值指标积极布局交易策略。我们对于 A 股市场后续依然保持谨慎乐观，在不大幅变动权益仓位的基础上，利用结构上的再平衡争取获取长期稳健的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末财通资管双盈债券发起式 A 份额净值为 1.1145 元，本报告期财通资管双盈债券发起式 A 份额净值增长率为 0.44%，同期业绩比较基准收益率为 1.74%；截至本报告期末财通资管双盈债券发起式 C 份额净值为 1.0936 元，本报告期财通资管双盈债券发起式 C 份额净值增长率为 0.34%，同期业绩比较基准收益率为 1.74%。

#### 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   | 71,974,383.00  | 10.59        |
|    | 其中：股票  | 71,974,383.00  | 10.59        |
| 2  | 基金投资   | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资 | 587,022,554.83 | 86.40        |
|    | 其中：债券  | 582,960,942.78 | 85.80        |
|    | 资产支持证券 | 4,061,612.05   | 0.60         |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 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      | 20,376,763.88  | 3.00   |
| 8 | 其他资产              | 41,306.09      | 0.01   |
| 9 | 合计                | 679,415,007.80 | 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

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 390,240.00    | 0.06         |
| B  | 采矿业              | 8,306,960.00  | 1.23         |
| C  | 制造业              | 46,968,604.60 | 6.94         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,088,998.00  | 0.31         |
| E  | 建筑业              | 1,380,013.00  | 0.20         |
| F  | 批发和零售业           | 1,300,080.00  | 0.19         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,926,257.00  | 0.58         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 364,728.00    | 0.05         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,050,069.40  | 0.30         |
| J  | 金融业              | 4,413,995.00  | 0.65         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 337,124.00    | 0.05         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 447,314.00    | 0.07         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 71,974,383.00 | 10.64        |

### 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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 688008 | 澜起科技 | 4,800  | 1,487,520.00 | 0.22         |
| 2  | 301377 | 鼎泰高科 | 2,600  | 1,432,340.00 | 0.21         |
| 3  | 000338 | 潍柴动力 | 50,000 | 1,362,500.00 | 0.20         |
| 4  | 688525 | 佰维存储 | 2,500  | 1,236,825.00 | 0.18         |
| 5  | 600938 | 中国海油 | 45,000 | 1,221,750.00 | 0.18         |
| 6  | 300604 | 长川科技 | 3,400  | 1,160,828.00 | 0.17         |
| 7  | 002128 | 电投能源 | 50,000 | 1,156,000.00 | 0.17         |
| 8  | 688668 | 鼎通科技 | 3,000  | 1,119,900.00 | 0.17         |
| 9  | 301200 | 大族数控 | 2,900  | 1,045,885.00 | 0.15         |
| 10 | 002281 | 光迅科技 | 4,000  | 1,027,760.00 | 0.15         |

### 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      | 10,104,923.29  | 1.49         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 184,688,062.46 | 27.30        |
|    | 其中：政策性金融债 | 122,549,936.98 | 18.11        |
| 4  | 企业债券      | 108,599,180.83 | 16.05        |
| 5  | 企业短期融资券   | 40,144,372.61  | 5.93         |
| 6  | 中期票据      | 210,981,789.36 | 31.18        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 28,442,614.23  | 4.20         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 582,960,942.78 | 86.16        |

### 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  | 240202    | 24 国开 02      | 500,000 | 50,832,369.86 | 7.51         |
| 2  | 230203    | 23 国开 03      | 400,000 | 41,331,594.52 | 6.11         |
| 3  | 2128025   | 21 建设银行二级 01  | 300,000 | 30,986,260.27 | 4.58         |
| 4  | 250211    | 25 国开 11      | 300,000 | 30,385,972.60 | 4.49         |
| 5  | 102582116 | 25 苏交通 MTN003 | 300,000 | 30,156,764.38 | 4.46         |

### 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  | 262605 | 24 财鑫 A2 | 40,000 | 4,061,612.05 | 0.60         |

## 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 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，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银

行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。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国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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 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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约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   | 39,277.20 |
| 2  | 应收证券清算款 | —         |
| 3  | 应收股利    | —         |
| 4  | 应收利息    | —         |
| 5  | 应收申购款   | 2,028.89  |
| 6  | 其他应收款   | —         |
| 7  | 其他      | —         |
| 8  | 合计      | 41,306.09 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 127110 | 广核转债    | 4,346,116.27 | 0.64         |
| 2  | 113693 | 志邦转债    | 3,365,306.99 | 0.50         |
| 3  | 127108 | 太能转债    | 3,115,457.19 | 0.46         |
| 4  | 118024 | 冠宇转债    | 2,598,238.36 | 0.38         |
| 5  | 113052 | 兴业转债    | 2,301,752.88 | 0.34         |
| 6  | 110085 | 通 22 转债 | 1,791,216.66 | 0.26         |
| 7  | 127040 | 国泰转债    | 1,222,093.29 | 0.18         |
| 8  | 127089 | 晶澳转债    | 1,220,166.44 | 0.18         |

|    |        |         |              |      |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 9  | 123107 | 温氏转债    | 1,110,230.55 | 0.16 |
| 10 | 113053 | 隆 22 转债 | 952,725.70   | 0.14 |
| 11 | 110099 | 福能转债    | 702,122.05   | 0.10 |
| 12 | 113652 | 伟 22 转债 | 385,772.88   | 0.06 |

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 财通资管双盈债券发起式 A  | 财通资管双盈债券发起式 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 486,977,357.13 | 16,553,009.06 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 153,046,461.44 | 4,033,811.24  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 39,460,307.65  | 13,939,312.71 |
| 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               | 600,563,510.92 | 6,647,507.59  |

注：申购含红利再投、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

本报告期内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

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

### § 8 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 | -      | -            | -      | -            | -          |

|                 |           |       |   |   |   |
|-----------------|-----------|-------|---|---|---|
| 基金管理人<br>高级管理人员 | -         | -     | - | - | - |
| 基金经理等<br>人员     | 84,268.17 | 0.01% | - | - | - |
| 基金管理人<br>股东     | -         | -     | - | - | - |
| 其他              | -         | -     | - | - | - |
| 合计              | 84,268.17 | 0.01% | - | - | - |

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 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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              | 20260401-<br>20260409, 20260420-<br>20260426, 20260522-20260628 | 113,351,243.06 | -    | -    | 113,351,243.06 | 18.67% |
|                                                                                            | 2              | 20260401-<br>20260409, 20260420-<br>20260426, 20260522-20260628 | 113,346,189.67 | -    | -    | 113,346,189.67 | 18.67% |
|                                                                                            | 3              | 20260401-<br>20260409, 20260420-<br>20260426, 20260522-20260628 | 113,344,465.25 | -    | -    | 113,344,465.25 | 18.67% |
| 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。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内，本基金托管人华夏银行股份有限公司 2026 年 6 月聘任赵伟婧为资产托管部副总经理。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、财通资管双盈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、财通资管双盈债券型发起式证券投资基金托管协议
- 4、财通资管双盈债券型发起式证券投资基金基金合同
- 5、财通资管双盈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

### 10.2 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

### 10.3 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 07 月 21 日