

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） 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：中国光大银行股份有限公司
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。

基金托管人中国光大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	172,747,616.92 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	94,729,851.16 份	78,017,765.76 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	69,057.38	13,009.02
2. 本期利润	2,114,026.77	1,438,220.43
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0230	0.0207
4. 期末基金资产净值	109,086,219.08	88,969,996.07
5. 期末基金份额净值	1.1516	1.1404

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

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	2.06%	0.16%	1.74%	0.14%	0.32%	0.02%
过去六个月	2.57%	0.17%	1.62%	0.12%	0.95%	0.05%
过去一年	3.99%	0.13%	1.98%	0.11%	2.01%	0.02%
过去三年	11.62%	0.09%	7.80%	0.11%	3.82%	-0.02%

自基金合同生效起至今	15.16%	0.08%	7.71%	0.11%	7.45%	-0.03%
------------	--------	-------	-------	-------	-------	--------

财通资管通达稳健 3 个月持有债券发起式（FOF）C

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	1.99%	0.16%	1.74%	0.14%	0.25%	0.02%
过去六个月	2.44%	0.17%	1.62%	0.12%	0.82%	0.05%
过去一年	3.73%	0.13%	1.98%	0.11%	1.75%	0.02%
过去三年	10.79%	0.09%	7.80%	0.11%	2.99%	-0.02%
自基金合同生效起至今	14.04%	0.08%	7.71%	0.11%	6.33%	-0.03%

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



财通资管通达稳健 3 个月持有债券发起式（FOF）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		
罗少文	本基金基金经理、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）和财通资管通达稳鑫 3 个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金经理。	2024 年 12 月 27 日	—	7	硕士研究生学历、硕士学位。曾在国泰基金管理有限公司、永赢基金管理有限公司、信银理财有限责任公司工作。2024 年 8 月加入财通证券资产管理有限公司，曾任固收研究部研究员，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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

产品固收部分将仍以票息思路为主，短期仍重点配置有票息优势同时波动较低中短债及信用品种，利率今年波动较大，在当前时点预计短期仍将维持波动率震荡趋势。另外，目前各债券品种的绝对收益都在历史较低位区间，费率较低的基金仍会重点关注，适时对现有基金进行替换。债券部分收益回撤力争对标中长债基指数市场中位数，同时通过适当波段交易获取一定超额机会。

权益资产部分仍旧秉持较为均衡的资产配置策略。目前随着十年期国债收益率的下行，中证红利股息率与十年期国债收益率之间的差值已经来到历史较高分位水平，两者价差或进一步拉大，但近期权益市场的拉升也使得权益市场短期向上空间被一定程度上挤压。后续，将择机对相关资产进行配置，并不断优化投资组合结构，力争提升整体投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末财通资管通达稳健 3 个月持有债券发起式（FOF）A 份额净值为 1.1516 元，本报告期财通资管通达稳健 3 个月持有债券发起式（FOF）A 份额净值增长率为 2.06%，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通达稳健 3 个月持有债券发起式（FOF）C 份额净值为 1.1404 元，本报告期财通资管通达稳健 3 个月持有债券发起式（FOF）C 份额净值增长率为 1.99%，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	11,248,401.00	5.66
	其中：股票	11,248,401.00	5.66
2	基金投资	164,876,242.62	83.01
3	固定收益投资	9,094,430.96	4.58
	其中：债券	9,094,430.96	4.58
	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	10,063,170.34	5.07
8	其他资产	3,340,497.25	1.68
9	合计	198,622,742.17	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	—	—
B	采矿业	781,440.00	0.39
C	制造业	7,375,337.00	3.72

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	420,000.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,540.00	0.06
J	金融业	2,426,204.00	1.23
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	126,880.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
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	11,248,401.00	5.68

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	600919	江苏银行	100,200	1,080,156.00	0.55
2	600066	宇通客车	36,000	965,160.00	0.49
3	601225	陕西煤业	38,400	781,440.00	0.39
4	000895	双汇发展	25,200	564,480.00	0.29
5	600036	招商银行	13,600	482,800.00	0.24
6	000651	格力电器	12,800	480,000.00	0.24
7	601166	兴业银行	26,800	443,808.00	0.22
8	300475	香农芯创	1,400	420,000.00	0.21
9	601169	北京银行	85,600	419,440.00	0.21
10	301217	铜冠铜箔	2,500	412,675.00	0.21

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	9,094,430.96	4.59
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	9,094,430.96	4.59

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	019792	25 国债 19	90,000	9,094,430.96	4.59

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，易方达基金管理有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会广东监管局的处罚。汇添富基金管理股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会上海监管局的处罚。博时基金管理有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会深圳监管局的处罚。

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	10,731.23
2	应收证券清算款	230,000.00
3	应收股利	—
4	应收利息	—

5	应收申购款	3, 099, 766. 02
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	3, 340, 497. 25

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 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	021606	易方达中债新综指 (LOF) D	契约型 开放式	8, 855, 500. 91	15, 819, 466. 83	7. 99	否
2	014485	汇添富中债 1-3 年隐含评级 AA+ 及以上信用债指数发起式 C	契约型 开放式	14, 075, 920. 76	15, 545, 446. 89	7. 85	否
3	013449	广发景宁纯债 C	契约型 开放式	11, 283, 657. 61	13, 625, 016. 56	6. 88	否
4	022477	鹏华丰顺债券 C	契约型 开放式	12, 109, 594. 49	12, 776, 833. 15	6. 45	否
5	006542	财通资管鸿利中短债债券 A	契约型 开放式	10, 809, 757. 52	12, 245, 293. 32	6. 18	是
6	017838	博时中债 7-10	契约型	10, 247, 781. 25	11, 785, 973. 22	5. 95	否

		政金债指数 C	开放式				
7	018743	易方达优选投资级信用指数发起式 C	契约型开放式	7,324,130.43	7,578,277.76	3.83	否
8	013380	景顺长城景泰纯利债券 C	契约型开放式	5,334,231.25	6,343,467.80	3.20	否
9	018254	平安利率债 C	契约型开放式	5,910,727.35	6,245,274.52	3.15	否
10	018253	平安利率债 A	契约型开放式	5,011,709.33	5,333,461.07	2.69	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不动产投资信托基金投资明细

本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2026 年 04 月 01 日至 2026 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）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	53,272.72	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	127,213.36	9,137.82
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	33,263.43	1,522.96
当期交易所交易基金产生的交易费（元）	81.75	-

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

项目	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	90,256,983.63	56,291,760.88
报告期期间基金总申购份额	11,957,771.52	34,493,358.11
减：报告期期间基金总赎回份额	7,484,903.99	12,767,353.23
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	94,729,851.16	78,017,765.76

注：申购含红利再投、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

项目	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	17,954,035.37	-
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	17,954,035.37	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	10.39	-

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	17,954,035.37	10.39%	—	—	—
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	18,986.52	0.01%	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	17,973,021.89	10.40%	—	—	—

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。

§ 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

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。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 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

2026 年 07 月 21 日