

---

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)

2022年第3季度报告

2022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:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月26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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月25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2022年07月07日起至09月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）
基金主代码	015776
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年07月07日
报告期末基金份额总额	36,247,677.85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	本基金为混合型基金中基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于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	中国民生银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）A	财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）C
下属分级基金的交易代码	015776	015777
报告期末下属分级基金的份额总额	33,665,071.06份	2,582,606.79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(2022年07月07日 - 2022年09月30日)	
	财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）A	财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）C
1. 本期已实现收益	238,994.64	14,705.11
2. 本期利润	287,346.72	17,807.42
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0087	0.0074
4. 期末基金资产净值	33,960,912.44	2,602,266.98
5. 期末基金份额净值	1.0088	1.0076

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、本期已实现收益指本期基金利息收入、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、基金合同于2022年07月07日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一季度。

#### 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

财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）A净值表现

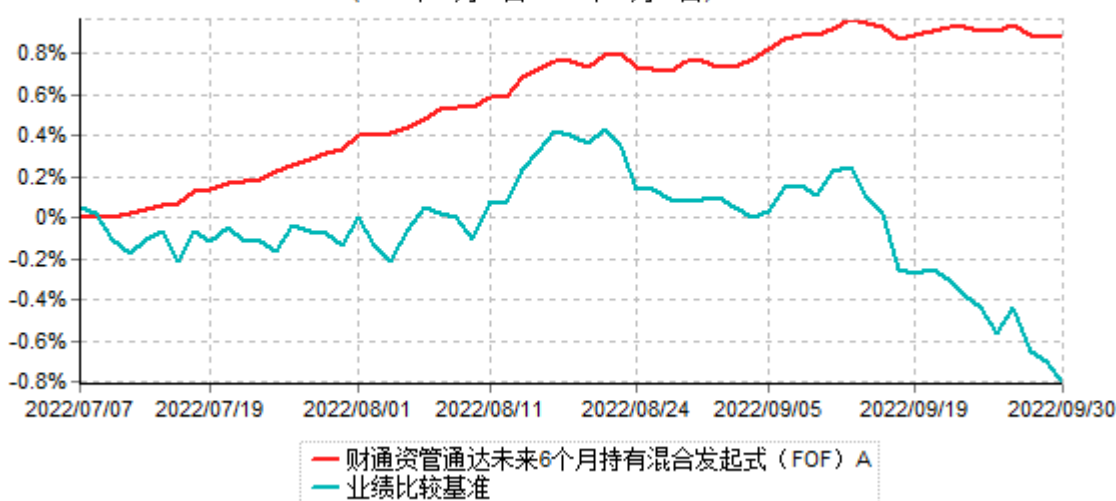
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.88%	0.03%	-0.81%	0.10%	1.69%	-0.07%

财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）C净值表现

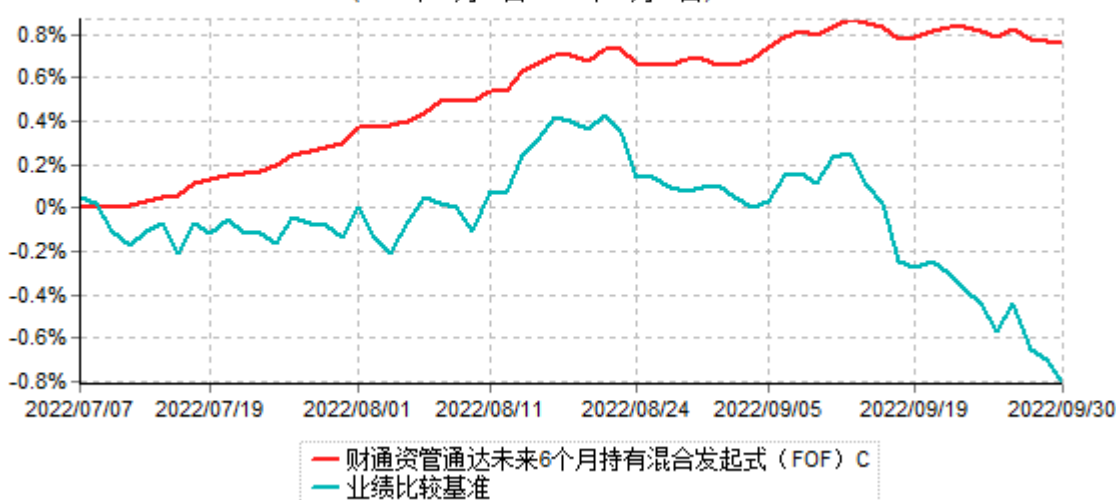
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.76%	0.03%	-0.81%	0.10%	1.57%	-0.07%

### 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

财通资管通达未来6个月持有混合发起式（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07月07日-2022年09月30日)



财通资管通达未来6个月持有混合发起式（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07月07日-2022年09月30日)



注：1、本基金合同于2022年07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6个月，截止报告期末，本基金尚未建仓完毕。

## § 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、财通资管通达稳健3个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）和财通资管通达稳利3个月定期开放债券型发起式基金中基金（FOF）基金经理。	2022-07-07	-	5	马里兰大学帕克分校博士。2017年8月加入财通证券资产管理有限公司，历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《财通资管通达未来6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》、《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）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

2022年三季度，海外利空因素较多。美联储的加息步伐和俄乌冲突不断改变预期，全球制造业PMI维持收缩趋势，欧美市场通胀数据改善有限，各类资产波动较大。全球股市大多震荡下跌，美债利率曲线整体上移，且出现较深的长短端收益率倒挂，市场担忧并开始定价经济衰退。我国经济基本面情况在三季度的变化有限，疫情仍继续干扰着消费的修复，房地产的投资销售仍在底部徘徊，经济主要靠出口、基建和制造业投资支撑。综合来看，我国和其他主要经济体处于经济周期不同阶段，中外政策也相应维持在内松外紧状态，国内资产也表现不一。三季度以来人民币汇率贬值破7，股票整体表现欠佳且风格上切换较为频繁，债券收益率震荡下行。

展望四季度，预计宏观经济波动率仍然偏高，一些风险事件和利空因素大概率不会完全消除，如地缘冲突、美联储加息和局部疫情爆发等，对未来的不确定可能会使得市场的风险偏好继续处于偏低状态。此外，受到海外需求和中美贸易摩擦等影响，支撑前三季度的出口增速也有下滑的可能性。但海外因素对国内市场的压制力度高点似乎已经过去，压力趋缓后股债均可能会在局部出现投资机会。从目前的保交付和销售放松等政策实施来看，房地产边际上的改善可以期盼，四季度的经济增长支撑项有可能发生变化。

本基金目标定位稳健，重视组合的回撤和波动控制。在三季度基金成立以来，重点关注和把握流动性宽裕和债券收益率下行的机会，积极参与固收类资产的配置和交易，精细筛选含权债券型基金，严格控制权益类资产仓位。四季度会密切关注狭义流动性和政策面上的变化，继续在严控波动和回撤的前提下，布局一些较为均衡、策略稳定的基金，并择机配置合适的固收类资产，构建一个稳定的投资组合。

### 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未来6个月持有混合发起式（FOF）A基金份额净值为1.0088元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.88%，同期业绩比较基准收益率为-0.81%；截至报告期末财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）C基金份额净值为1.0076元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.76%，同期业绩比较基准收益率为-0.81%。

### 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	20,841,488.23	53.32
3	固定收益投资	3,526,453.91	9.02
	其中：债券	3,526,453.91	9.02
	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	14,625,275.78	37.41
	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	93,524.43	0.24
8	其他资产	3,158.61	0.01
9	合计	39,089,900.96	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	3,526,453.91	9.64

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	3,526,453.91	9.64

### 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	019638	20国债09	18,000	1,817,070.90	4.97
2	019679	22国债14	15,000	1,506,626.30	4.12
3	019547	16国债19	2,000	202,756.71	0.55

### 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 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	164.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,128.31
6	其他应收款	865.72
7	其他	-
8	合计	3,158.61

### 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，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	002901	财通资管 积极收益 A	契约型开 放式	4,282,29 8.14	5,164,87 9.79	14.13	是
2	007916	财通资管 鸿福短债 C	契约型开 放式	3,150,50 5.60	3,513,75 8.90	9.61	是
3	008922	财通资管 鸿运中短 债E	契约型开 放式	3,297,26 9.21	3,511,59 1.71	9.60	是
4	012580	财通资管 鸿安30天 滚动持有 A	契约型开 放式	3,158,36 9.86	3,341,23 9.47	9.14	是
5	161019	富国新天 锋	契约型开 放式	1,870,50 2.47	2,026,31 5.33	5.54	否
6	675111	西部利得 汇享A	契约型开 放式	841,073.6 1	1,006,84 9.22	2.75	否
7	009617	东兴兴利 C	契约型开 放式	939,231.7 1	1,006,29 2.85	2.75	否
8	005852	中银稳健 添利C	契约型开 放式	766,546.7 1	997,123. 96	2.73	否
9	511010	国债ETF	交易型开 放式	1,200.00	154,536. 00	0.42	否
10	511260	十年国债	交易型开 放式	1,000.00	118,901. 00	0.33	否

### 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用2022年07月07日至 2022年09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）	900.66	-
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）	3,254.03	3,008.94
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	19,827.98	14,056.41
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	5,457.86	3,741.96

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

	财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）A	财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）C
基金合同生效日（2022年07月07日）基金份额总额	32,579,388.28	2,316,628.64
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,085,682.78	265,978.15
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	33,665,071.06	2,582,606.79

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

	财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）A	财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）C
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	10,000,200.02	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/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（%）	27.59	-

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人无运用固有资金申购、赎回本基金的情况。

## § 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	27.59%	10,000,200.02	27.59%	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	50,001.00	0.14%	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,050,201.02	27.73%	10,000,200.02	27.59%	-

## § 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	20220707-20220930	9,999,200.00	-	-	9,999,200.00	27.59%
	2	20220707-20220930	10,000,200.02	-	-	10,000,200.02	27.59%
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

报告期内，本基金管理人上海分公司住所于2022年8月2日变更至上海市虹口区东大名路501号4503、4504室。

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、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）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、财通资管通达未来6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议
- 4、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）基金合同
- 5、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）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四宜路四宜大院B幢办公楼

### 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：95336

公司网址：[www.ctzg.com](http://www.ctzg.com)

财通证券资产管理有限公司

2022年10月26日