

财通可转债债券型证券投资基金2020年第4季度报告
(原“财通多策略稳健增长债券型证券投资基金”转型)

2020年12月31日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2021年01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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1月20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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

基金管理人于2017年4月14日起对本基金增设收取销售服务费的C类份额，基金简称：财通多策略稳健增长债券C，基金代码：003205，基金份额持有人持有的原份额变更为A类份额，基金简称：财通多策略稳健增长债券A，基金代码：720002。

财通多策略稳健增长债券型证券投资基金自2020年10月20日起转型，基金名称变更为“财通可转债债券型证券投资基金”，基金简称变更为“财通可转债债券”，A类基金份额基金简称将变更为“财通可转债债券A”（基金代码：720002），C类基金份额基金简称将变更为“财通可转债债券C”（基金代码：003205）。

本报告期自2020年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

转型后

基金简称	财通可转债债券
场内简称	-
基金主代码	720002
交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金转型合同生效日	2020年10月20日
报告期末基金份额总额	17,891,990.11份
投资目标	本基金为债券型证券投资基金，债券投资部分以可转换债券为主要投资标的，在保持适当流动性、合理控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金定位为债券型基金，其长期战略性资产配置

	<p>以债券为主。同时，在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、公司基本面、市场估值水平以及投资者情绪，在一定的范围内对债券、股票和现金各自的投资比例作战术性资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。</p> <p>本基金投资于可转换债券，主要目标是发挥可转换债券兼具股性和债性的特性，一方面可转换债券具有债券的价值底线，能够降低基金净值的下行风险；另一方面，正股上涨会显著提升可转债的投资价值，为组合带来超额收益。</p> <p>可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票，而是发行人持有的其他上市公司的股票。可交换债券同样具有股性和债性，其中债性与可转换债券相同，即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而对于股性的分析则需关注目标公司的股票价值。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。</p>	
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率*80%+中债综合指数收益率*10%+沪深300指数收益率*10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和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。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资品种。	
基金管理人	财通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	财通可转债债券A	财通可转债债券C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	720002	003205
报告期末下属分级基金的份额总额	17,440,831.21份	451,158.90份
下属分级基金的风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和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。本基金主要投资于可转	本基金为债券型基金，其预期风险和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。本基金主要投资于可转

	换债券,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资品种。	换债券,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资品种。
--	-----------------------------	-----------------------------

转型前

基金简称	财通多策略稳健增长债券
场内简称	-
基金主代码	720002
交易代码	-
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2012年07月13日
报告期末基金份额总额	18,396,365.04份
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争持续稳定地实现超越业绩比较基准的组合收益。
投资策略	<p>本基金主要通过以下两个策略进行资产配置:第一,以广义动态固定比例投资组合保险策略(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance)为基本策略,动态调整安全资产与风险资产的投资比例,力争在有效控制风险的前提下,实现稳健的组合收益;第二,实施时间不变性投资组合保险策略(TIPP, Time Invariant Portfolio Protection),通过定期强制实施收益分配锁定部分阶段收益,不断提高单位运作周期到期时的目标价值。</p> <p>本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行安全资产的投资,主要投资策略包括债券投资组合策略和动态品种优化策略。</p> <p>本基金的风险资产投资策略包括基于可转债的收益增强策略、二级市场股票投资策略、新股申购策略及权证投资策略等。</p>
业绩比较基准	每个单位运作周期起始日的3年期银行定期存款税后收益率+0.5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期的风险水平和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	财通基金管理有限公司

基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	财通多策略稳健增长债券A	财通多策略稳健增长债券C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	720002	003205
报告期末下属分级基金的份额总额	17,945,389.88份	450,975.16份
下属分级基金的风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期的风险水平和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期的风险水平和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年10月20日 - 2020年12月31日)	
	财通可转债债券A	财通可转债债券C
1.本期已实现收益	346,377.51	9,209.63
2.本期利润	953,377.27	25,678.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0538	0.0569
4.期末基金资产净值	18,862,117.76	516,938.14
5.期末基金份额净值	1.0815	1.1458

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)根据本基金基金份额持有人大会决议，本基金自2020年10月20日起转型为财通可转债债券型证券投资基金。

3.2 主要财务指标(转型前)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年10月01日 - 2020年10月19日)	
	财通可转债债券A	财通可转债债券C

1.本期已实现收益	12,621.34	2,738.26
2.本期利润	25,925.60	6,571.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0012	0.0009
4.期末基金资产净值	19,056,980.67	504,588.93
5.期末基金份额净值	1.0619	1.1189

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)本基金自2017年4月14日起将各类基金份额净值计算保留到小数点后的位数更改为4位。

3.3 基金净值表现(转型后)

3.3.1 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

财通可转债债券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	5.32%	0.71%	1.30%	0.46%	4.02%	0.25%

财通可转债债券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	5.23%	0.71%	1.30%	0.46%	3.93%	0.25%

注：(1)本基金自 2020 年 10 月 20 日起转型为财通可转债债券型证券投资基金。

(2) 本基金业绩比较基准为：中证可转换债券指数收益率*80%+中债综合指数收益率*10%+沪深 300 指数收益率*10%。

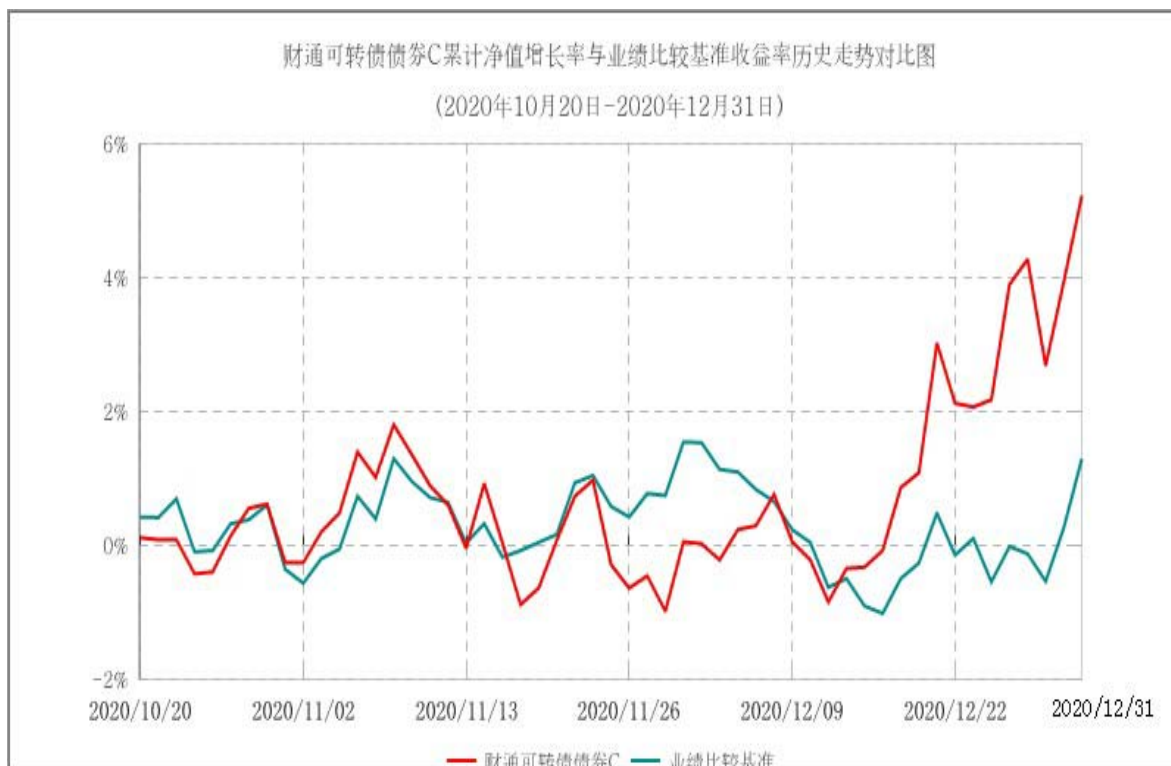
3.3.2 自基金合同转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：(1)本基金自 2020 年 10 月 20 日起转型为财通可转债债券型证券投资基金。

(2)本基金建仓期为自合同生效起 6 个月，截至建仓期末和本报告期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求；

(3) 本基金业绩比较基准为：中证可转换债券指数收益率*80%+中债综合指数收益率*10%+沪深 300 指数收益率*10%。



注：(1)本基金自 2020 年 10 月 20 日起转型为财通可转债债券型证券投资基金。

(2)本基金建仓期为自合同生效起 6 个月，截至建仓期末和本报告期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求；

(3) 本基金业绩比较基准为：中证可转换债券指数收益率*80%+中债综合指数收益率*10%+沪深 300 指数收益率*10%。

3.4 基金净值表现(转型前)

3.4.1 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

财通多策略稳健增长债券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（2020年10月1日至2020年10月19日）	3.70%	0.39%	1.01%	0.01%	2.69%	0.38%
过去六个月	10.28%	0.81%	2.68%	0.01%	7.60%	0.80%
过去一年	16.19%	0.48%	9.97%	0.01%	6.22%	0.47%
过去三年	12.47%	0.38%	18.67%	0.01%	-6.20%	0.37%
过去五年	42.58%	0.33%	39.59%	0.01%	2.99%	0.32%
自基金合同生效起至今	42.58%	0.33%	0.00%	0.00%	42.58%	0.33%

财通多策略稳健增长债券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（2020年10月1日至2020年10月19日）	-0.04%	0.05%	0.17%	0.03%	-0.21%	0.02%
过去六个月	3.45%	0.39%	1.01%	0.01%	2.44%	0.38%
过去一年	9.77%	0.81%	2.68%	0.01%	7.09%	0.80%
过去三年	14.30%	0.48%	9.97%	0.01%	4.33%	0.47%
自基金合同生效起至今	14.30%	0.48%	9.97%	0.01%	4.33%	0.47%

注：(1)上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)本基金业绩比较基准为：每个单位运作周期起始日的3年期银行定期存款税后收益率+0.5%。

(3)本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额。

3.4.2 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



- 注：(1)本基金合同生效日为 2012 年 7 月 13 日；
 (2)本基金建仓期为自合同生效起 6 个月，截至建仓期末和本报告期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求；
 (3) 本基金业绩比较基准为：每个单位运作周期起始日的 3 年期银行定期存款税后收益率+0.5%；
 (4)本基金自 2017 年 4 月 14 日起增设收取销售服务费的 C 类份额，原份额变更为 A 类份额。

§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		
林洪钧	本基金的基金经理、公司固定收益投资总监兼固定收益部总监	2018年9月14日	-	16年	复旦大学工商管理硕士、力学与工程科学本科。历任国泰君安证券股份有限公司上海分公司机构客户部客户经理，华安基金管理有限公司债券交易员，加拿大Financial Engineering Source Inc.金融研究员，交银施罗德基金管理有限公司固定收益部债券研究员、专户投资部投资经理、固定收益部助理总经理/基金经理，光大保德信基金管理有限公司固定收益部固定收益投资总监，兴证证券资产管理有限公司固定收益投资三部固收总监。2018年8月加入财通基金管理有限公司，现任公司固定收益投资总监兼固定收益部总监、基金经理。
杨焯超	本基金的基金经理	2020年5月14日	-	10年	复旦大学世界经济本硕。2010年7月至2018年6月就职于光大保德信基金管理有限公司，历任市场部产品助理、产品经理、固定收益部研究员、基金经理。2018年7月加入财通基金管理有限公司，曾担任固定收益部投资经理，现任

					固定收益部基金经理。
--	--	--	--	--	------------

注：(1)基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期；

(2)非首任基金经理，其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，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

本基金管理人以价值投资为理念，致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系，营造公平交易的执行环境。公司通过严格的内控制度和授权体系，确保投资、研究、交易等各个环节的独立性。公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易，并建立了公平的交易分配制度，确保在场内、场外各类交易中，各投资组合都享有公平的交易执行机会。

同时，公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库，在此平台上共享研究成果，并对各组合提供无倾向性支持；在公用备选库的基础上，各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上，形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中适当启用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节，特殊情况会经过严格的报告和审批程序，会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析，以排查异常交易。

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通基金管理有限公司公平交易制度》的规定，未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合及短期国债回购交易除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。

如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易（短期国债回购交易除外）的情况，也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

经过事前制度约束、事中严密监控，以及事后的统计排查，本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明，本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响，亦未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020年四季度，债券收益率呈现先上后下态势。债市由暴跌向阴跌切换，10年期国债收益率震荡上行近16bp后回落。基本面角度看，各项经济指标在4季度继续缓慢回升，融资、投资、生产等活动继续向好，通胀整体在可控水平。基本面对债券市场整体中性偏空。4季度市场主要跟随政策预期变化，货币政策从中性转为短期宽松。12月以来政策的边际宽松带动了收益率出现下行，但从长期看，政策“不急转弯”不等于“不转弯”，因此观察货币政策的视角还是应该采取中性视角。我们保持短久期以及高流动性的灵活策略。根据期限利差调整组合仓位，维持组合流动性的同时保持组合收益稳定。权益市场方面，整体风险偏好有所抬升，4季度在消费、新能源等板块行情出现轮动，本基金在控制波动的情形下，通过挖掘业绩稳定且估值合理的标的，为组合增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2020年10月19日，财通多策略稳健增长债券A基金份额净值为1.0619元；自2020年10月1日至2020年10月19日本基金份额净值增长率为3.70%，同期业绩比较基准收益率为1.01%。

截至2020年10月19日，财通多策略稳健增长债券C基金份额净值为1.1189元；自2020年10月1日至2020年10月19日本基金份额净值增长率为-0.04%，同期业绩比较基准收益率为0.17%。

截至2020年12月31日，财通可转债债券A基金份额净值为1.0815元；自2020年10月20日至2020年12月31日本基金份额净值增长率为5.32%，同期业绩比较基准收益率为1.30%。

截至2020年12月31日，财通可转债债券C基金份额净值为1.1458元；自2020年10月20日至2020年12月31日本基金份额净值增长率为5.23%，同期业绩比较基准收益率为1.30%。

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，本基金未有连续20个交易日基金份额持有人数量不满200人的情况出现；本基金资产净值于2018年10月22日至2020年10月19日期间连续484个工作日低于5000万元。本基金转型后资产净值于2020年10月20日至2020年12月31日期间连续53个工作日低

于5000万元本基金管理人已根据法规要求向中国证监会报告并提出解决方案，后续将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§5 投资组合报告(转型后)

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	2,665,814.00	13.32
	其中：股票	2,665,814.00	13.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,779,355.30	78.86
	其中：债券	15,779,355.30	78.86
	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	1,000,000.00	5.00
	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	496,268.42	2.48
8	其他资产	67,539.68	0.34
9	合计	20,008,977.40	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	-	-
C	制造业	1,816,409.00	9.37
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	-	-
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	-	-
J	金融业	595,200.00	3.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	254,205.00	1.31
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	2,665,814.00	13.76

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通过港股通机制投资的港股。

5.3 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	300059	东方财富	19,200	595,200.00	3.07
2	600519	贵州茅台	200	399,600.00	2.06
3	601888	中国中免	900	254,205.00	1.31
4	603520	司太立	3,700	243,571.00	1.26
5	000858	五粮液	800	233,480.00	1.20
6	600309	万华化学	2,300	209,392.00	1.08
7	002493	荣盛石化	7,400	204,314.00	1.05
8	603456	九洲药业	5,700	204,060.00	1.05
9	300298	三诺生物	4,500	161,100.00	0.83
10	300502	新易盛	2,900	160,892.00	0.83

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	1,000,400.00	5.16
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）	14,778,955.30	76.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,779,355.30	81.42

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	113011	光大转债	9,120	1,129,785.60	5.83
2	019535	16国债07	10,000	1,000,400.00	5.16
3	132009	17中油E B	9,480	960,229.20	4.95
4	110059	浦发转债	9,280	944,704.00	4.87
5	113013	国君转债	7,770	928,359.60	4.79

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持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金不投资股指期货。

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

本基金暂不投资国债期货。

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持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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中浦发转债（证券代码：110059.SH）的发行主体浦发银行在报告编制日前一年内受到上海银保监局的行政处罚；长证转债（证券代码：127005.SZ）的发行主体长江证券在报告编制日前一年内受到中国证监会的行政处罚。除上述情形外，本基金投资的前十大证券的其他发行主体没有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、处罚的情形。

本基金投以上证券的投资决策程序为：

- 1、投资决策委员会确定每个产品的基本投资逻辑；
- 2、投资研究体系中的研究平台是一个共享平台，为投资决策全流程提供研究支持；
- 3、基金经理拟订所管理产品的投资计划与方案；
- 4、金融工程小组对基金经理/投资经理的投资计划进行风险评价，并向投资决策委员会提交评估报告；
- 5、投资决策委员会对基金经理/投资经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要；
- 6、根据决策纪要，基金经理/投资经理对计划方案进行具体实施；
- 7、中央交易室按有关交易规则执行基金经理/投资经理下达的交易指令，并将有关信息进行反馈；
- 8、基金经理/投资经理定期检讨投资组合的运作成效；
- 9、金融工程小组定期为投资决策委员会、投资总监、基金经理/投资经理出具绩效与风险评估报告。

5.11.2 报告期内，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	6,461.74
2	应收证券清算款	451.51
3	应收股利	-
4	应收利息	55,890.24
5	应收申购款	4,736.19
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	67,539.68

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	113011	光大转债	1,129,785.60	5.83
2	110059	浦发转债	944,704.00	4.87
3	113013	国君转债	928,359.60	4.79
4	110053	苏银转债	923,457.80	4.77
5	113545	金能转债	847,330.00	4.37
6	127005	长证转债	730,012.50	3.77
7	128017	金禾转债	593,019.20	3.06
8	128095	恩捷转债	555,891.60	2.87
9	110065	淮矿转债	394,693.00	2.04
10	113025	明泰转债	394,500.30	2.04
11	113026	核能转债	384,685.20	1.99
12	110051	中天转债	368,451.60	1.90
13	113583	益丰转债	366,039.70	1.89
14	123017	寒锐转债	241,149.50	1.24
15	113582	火炬转债	220,267.50	1.14
16	110041	蒙电转债	182,180.30	0.94
17	123044	红相转债	181,657.70	0.94
18	128046	利尔转债	181,650.30	0.94
19	110068	龙净转债	176,095.80	0.91
20	113588	润达转债	167,434.80	0.86
21	128028	赣锋转债	164,539.60	0.85
22	127015	希望转债	162,621.00	0.84

23	113563	柳药转债	86,204.80	0.44
24	110066	盛屯转债	81,730.00	0.42

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，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 投资组合报告（转型前）

6.1 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	1,161,423.00	5.44
	其中：股票	1,161,423.00	5.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,248,268.50	76.11
	其中：债券	16,248,268.50	76.11
	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	3,702,440.24	17.34
8	其他资产	235,229.31	1.10
9	合计	21,347,361.05	100.00

6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

6.2.1 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	-	-

C	制造业	1,161,423.00	5.94
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	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	1,161,423.00	5.94

6.2.2 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通过港股通机制投资的港股。

6.3 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	002507	涪陵榨菜	4,100	195,201.00	1.00
2	002460	赣锋锂业	3,400	195,160.00	1.00
3	603456	九洲药业	5,700	195,054.00	1.00
4	603520	司太立	2,500	193,750.00	0.99
5	002050	三花智控	8,700	193,314.00	0.99
6	000858	五粮液	800	188,944.00	0.97

6.4 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	14,258,068.50	72.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,990,200.00	10.17
	其中：政策性金融债	1,990,200.00	10.17
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	16,248,268.50	83.06

6.5 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	019627	20国债01	100,450	10,037,968.50	51.31
2	019547	16国债19	35,000	3,219,300.00	16.46
3	200306	20进出06	20,000	1,990,200.00	10.17
4	019535	16国债07	10,000	1,000,800.00	5.12

6.6 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。

6.7 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。

6.8 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。

6.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.9.1 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持有股指期货合约。

6.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金不投资股指期货。

6.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.10.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

6.10.2 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持有国债期货合约。

6.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

6.11 投资组合报告附注

6.11.1 报告期内，本基金投资的前十大证券的其他发行主体没有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、处罚的情形。

6.11.2 报告期内，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

6.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,606.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	226,963.35
5	应收申购款	659.39
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	235,229.31

6.11.4 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。

6.11.6 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。

6.11.6 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，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§7 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

	财通可转债债券A	财通可转债债券C
基金合同生效日(2020年10月20日)基金份额总额	17,945,389.88	450,975.16
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	709,871.49	183.74
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,214,430.16	-
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	17,440,831.21	451,158.90

注：(1)总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额；

(2) 本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额。

§8 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

	财通可转债债券A	财通可转债债券C
报告期期初基金份额总额	24,301,363.81	16,088,501.14
报告期期间基金总申购份额	11,335.02	-
减：报告期期间基金总赎回份额	6,367,308.95	15,637,525.98
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	17,945,389.88	450,975.16

注：(1)总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额；

(2) 本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额。

§9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

9.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况发生。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《证券时报》及管理人网站进行了如下信息披露：

- 1、2020年10月16日披露了《财通多策略稳健增长债券型证券投资基金暂停大额申购（转换转入）业务的公告》；
- 2、2020年10月17日披露了《财通多策略稳健增长债券型证券投资基金分红公告》；
- 3、2020年10月20日披露了《财通多策略稳健增长债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》；
- 4、2020年10月20日披露了《财通可转债债券型证券投资基金风险揭示书》；
- 5、2020年10月20日披露了《财通可转债债券型证券投资基金基金产品资料概要》；
- 6、2020年10月20日披露了《财通可转债债券型证券投资基金基金合同》；
- 7、2020年10月20日披露了《财通可转债债券型证券投资基金基金合同生效的公告》；
- 8、2020年10月20日披露了《财通可转债债券型证券投资基金托管协议》；
- 9、2020年10月20日披露了《财通可转债债券型证券投资基金招募说明书（2020年10月20日公告）》；
- 10、2020年10月24日披露了《财通可转债债券型证券投资基金恢复大额申购（转换转入）业务的公告》；
- 11、2020年10月27日披露了《财通多策略稳健增长债券型证券投资基金2020年第三季度报告》；
- 12、2020年11月6日披露了《财通基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法人员假冒财通基金名义实施非法证券行为的公告》；
- 13、2020年12月15日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加信达证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；
- 14、2020年12月31日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2021倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告》；
- 15、2020年12月31日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；
- 16、本报告期内，公司按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定每日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、财通可转债债券型证券投资基金基金合同；
- 3、财通可转债债券型证券投资基金基金托管协议；
- 4、财通可转债债券型证券投资基金招募说明书及其更新；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心41楼。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：<http://www.ctfund.com>

财通基金管理有限公司
二〇二一年一月二十一日