

财通收益增强债券型证券投资基金2023年第3季度报告

2023年09月30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:2023年10月25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2023年10月24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。

本报告期自2023年7月1日起至9月30日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 财通收益增强债券   |
| 场内简称       | -  |
| 基金主代码      | 720003   |
| 交易代码       | -  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2015年12月25日  |
| 报告期末基金份额总额 | 280,046,433.16份  |
| 投资目标       | 在保持资产流动性和严格控制风险的基础上，综合利用多种投资策略，实现基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略       | <p>本基金长期战略性资产配置以债券为主。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>债券资产投资策略层面，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债券资产的投资，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；股票投资策略层面，本基金以价值投资为基本投资理念，结合定性分析与定量分析的结</p> |

|                 |   |   |
|-----------------|---|---|
|                 | 果，以价值选股、组合投资为原则，选择具备估值吸引力、增长潜力显著的公司股票构建本基金的股票投资组合；本基金在权证投资方面主要运用的策略包括价值发现策略和套利交易策略等；如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。 |   |
| 业绩比较基准          | 中债综合指数收益率   |   |
| 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。   |   |
| 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     | 财通收益增强债券A   | 财通收益增强债券C                                   |
| 下属分级基金场内简称      | -   | -   |
| 下属分级基金的交易代码     | 720003  | 003204                                      |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 51,401,561.38份  | 228,644,871.78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。 |

注：(1)财通保本混合型发起式证券投资基金基金合同生效日为2012年12月20日，根据合同规定，第一个保本周期到期日为2015年12月21日，本基金于2015年12月25日转型为非保本的债券型证券投资基金；

(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。

### §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(2023年07月01日 - 2023年09月30日) |               |
|----------------|--------------------------------|---------------|
|                | 财通收益增强债券A                      | 财通收益增强债券C     |
| 1.本期已实现收益      | 173,696.56                     | 361,707.65    |
| 2.本期利润         | -388,822.12                    | -2,127,558.30 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0075                        | -0.0093       |

|            |               |                |
|------------|---------------|----------------|
| 4.期末基金资产净值 | 68,707,478.40 | 291,928,707.28 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3367        | 1.2768         |

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)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。

### 3.2 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

财通收益增强债券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      | -0.62% | 0.21%     | 0.01%      | 0.05%         | -0.63% | 0.16% |
| 过去六个月      | -1.29% | 0.23%     | 0.95%      | 0.04%         | -2.24% | 0.19% |
| 过去一年       | -3.14% | 0.22%     | 0.62%      | 0.05%         | -3.76% | 0.17% |
| 过去三年       | 22.62% | 0.79%     | 4.54%      | 0.05%         | 18.08% | 0.74% |
| 过去五年       | 43.03% | 0.74%     | 7.27%      | 0.06%         | 35.76% | 0.68% |
| 自基金合同生效起至今 | 40.57% | 0.61%     | 4.85%      | 0.07%         | 35.72% | 0.54% |

财通收益增强债券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 | -0.72% | 0.21%     | 0.01%      | 0.05%         | -0.73% | 0.16% |
| 过去六个月 | -1.50% | 0.23%     | 0.95%      | 0.04%         | -2.45% | 0.19% |
| 过去一年  | -3.53% | 0.22%     | 0.62%      | 0.05%         | -4.15% | 0.17% |
| 过去三年  | 21.17% | 0.79%     | 4.54%      | 0.05%         | 16.63% | 0.74% |
| 过去五年  | 40.38% | 0.74%     | 7.27%      | 0.06%         | 33.11% | 0.68% |

|            |        |       |       |       |        |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 60.28% | 0.77% | 7.91% | 0.06% | 52.37% | 0.71% |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|

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：中债综合指数收益率；

(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。

### 3.2.2 自基金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

财通收益增强债券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

(2015年12月25日-2023年09月30日)



财通收益增强债券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  
(2017年04月14日-2023年09月30日)



注：(1)本基金合同生效日为 2012 年 12 月 20 日，根据合同规定，第一个保本周期到期日为 2015 年 12 月 21 日，本基金于 2015 年 12 月 25 日转型为非保本的债券型证券投资基金；  
(2)本基金的建仓期合同生效起 6 个月，截至建仓期末和本报告期末，本基金的资产配置符合基金契约的相关要求；  
(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。

## §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 |        |   |
| 匡恒 | 本基金的基金经理 | 2023-02-10  | -    | 12年    | 香港城市大学金融学硕士，特许金融分析师（CFA）。历任中泰证券股份有限公司交易员、研究员、投资经理，德邦证券股份有限公司投资经理、高级投资经理，华泰资产管理有限公司高级投资经理。2022年9月加 |

|     |                     |            |   |     |  |
|-----|---------------------|------------|---|-----|--|
|     |                     |            |   |     | 入财通基金管理有限公司，现任固收投资部基金经理。   |
| 罗晓倩 | 固收投资部总经理助理、本基金的基金经理 | 2022-07-08 | - | 11年 | 复旦大学投资学硕士。历任友邦保险有限公司风控岗，国华人寿保险股份有限公司交易员，汇添富基金管理有限公司债券研究员兼交易员，华福基金管理有限公司债券研究员兼交易员，东吴证券股份有限公司投资主办助理。2016年5月加入财通基金管理有限公司，曾任固收投资部基金经理助理，现任固收投资部总经理助理、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》的相关规定。

#### 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

无。

#### 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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《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》、基金合同和其他有关法律法规、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管理制度》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

基本面方面，三季度经济发展延续年初以来的回升态势，国民经济加快恢复，9月中国制造业采购经理指数（PMI）重回荣枯线以上。从供给端看，工业和服务业生产加快。从需求端看，国内需求继续扩大。市场销售加快恢复，服务消费增长较快，固定资产投资规模继续扩大，货物进出口同比降幅收窄，贸易结构继续优化。价格方面，居民消费价格同比由降转涨，工业生产者价格同比降幅收窄。就业形势总体稳定，城镇调查失业率有所下降。整体上看，我们认为今年经济运行将继续呈现温和复苏状态。

政策方面，7月24日政治局会议提出要加大宏观政策调控力度，着力扩大内需、提振信心、防范风险，不断推动经济运行持续好转、内生动力持续增强、社会预期持续改善、风险隐患持续化解，推动经济实现质的有效提升和量的合理增长。央行货币政策委员会三季度例会要求精准有力实施稳健的货币政策，搞好逆周期和跨周期调节，更好发挥货币政策工具的总量和结构双重功能，着力扩大内需、提振信心，加快经济良性循环，为实体经济提供更有力的支持。8月，央行下调逆回购、中期借贷便利（MLF）利率，9月，央行下调金融机构存款准备金率0.25个百分点。8月以来，央行和相关部委不断推出稳定



房地产市场的政策，如差别化住房信贷政策、新发放首套房贷利率政策动态调整机制调降首付比和二套房贷利率下限等。

资金面方面，在央行“保持流动性合理充裕”的政策思路下，今年的流动性环境整体较为宽松。我们认为：“保持信贷合理增长、节奏平稳”“落实好调增的再贷款再贴现额度，实施好存续结构性货币政策工具”政策推动下，结构性宽信用大概率持续。宽信用需要宽货币配合，预计四季度流动性整体或仍将维持宽松状态。

在三季度中，本基金纯债部分以中短久期高等级信用债和利率债配置为主，力求获取稳定票息回报，注重流动性管理。同时，较为积极地参与股票和转债市场，综合考虑企业经营景气度、股票估值、转债性价比等因素进行择券。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，财通收益增强债券A基金份额净值为1.3367元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.62%，同期业绩比较基准收益率为0.01%；截至报告期末，财通收益增强债券C基金份额净值为1.2768元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.72%，同期业绩比较基准收益率为0.01%。

#### 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个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

### §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              | 62,317,879.11  | 17.15         |
|    | 其中：股票             | 62,317,879.11  | 17.15         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 297,944,714.81 | 81.97         |
|    | 其中：债券             | 297,944,714.81 | 81.97         |
|    | 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 | 2,596,188.24   | 0.71   |
| 8 | 其他资产         | 614,315.83     | 0.17   |
| 9 | 合计           | 363,473,097.99 | 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              | 33,894,077.00 | 9.40         |
| 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  | 4,647,271.11  | 1.29         |
| J  | 金融业              | 22,422,841.00 | 6.22         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,353,690.00  | 0.38         |
| 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               | 62,317,879.11 | 17.28        |

### 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  | 601058 | 赛轮轮胎 | 1,721,200 | 21,704,332.00 | 6.02         |
| 2  | 600919 | 江苏银行 | 2,040,300 | 14,649,354.00 | 4.06         |
| 3  | 300037 | 新宙邦  | 161,000   | 7,055,020.00  | 1.96         |
| 4  | 601995 | 中金公司 | 96,500    | 3,614,890.00  | 1.00         |
| 5  | 603235 | 天新药业 | 90,000    | 2,580,300.00  | 0.72         |
| 6  | 601688 | 华泰证券 | 133,200   | 2,105,892.00  | 0.58         |
| 7  | 601500 | 通用股份 | 552,700   | 2,072,625.00  | 0.57         |
| 8  | 601555 | 东吴证券 | 243,500   | 2,052,705.00  | 0.57         |
| 9  | 002230 | 科大讯飞 | 32,400    | 1,641,384.00  | 0.46         |
| 10 | 688369 | 致远互联 | 36,807    | 1,572,763.11  | 0.44         |

### 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      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 30,777,498.22  | 8.53         |
|    | 其中：政策性金融债 | 20,480,345.21  | 5.68         |
| 4  | 企业债券      | 30,473,931.52  | 8.45         |
| 5  | 企业短期融资券   | 50,434,401.10  | 13.98        |
| 6  | 中期票据      | 106,844,695.68 | 29.63        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 79,414,188.29  | 22.02        |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 297,944,714.81 | 82.62        |

### 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  | 102100106 | 21四川机场MT N001 | 200,000 | 20,581,740.27 | 5.71         |

|   |           |                        |         |               |      |
|---|-----------|------------------------|---------|---------------|------|
| 2 | 210202    | 21国开02                 | 200,000 | 20,480,345.21 | 5.68 |
| 3 | 102101430 | 21杭州国资MT<br>N001(权益出资) | 200,000 | 20,216,885.25 | 5.61 |
| 4 | 102101860 | 21越秀集团MT<br>N002       | 200,000 | 20,135,180.33 | 5.58 |
| 5 | 012382012 | 23无锡建投SCP<br>001       | 200,000 | 20,132,677.60 | 5.58 |

**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 本报告期内基金投资的前十名证券的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收到公开谴责、处罚的情形。**

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   | 83,725.70  |
| 2  | 应收证券清算款 | 525,032.47 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 5,557.66   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 614,315.83 |

### 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  | 113050 | 南银转债  | 12,478,023.61 | 3.46         |
| 2  | 123158 | 宙邦转债  | 12,072,916.61 | 3.35         |
| 3  | 110073 | 国投转债  | 11,874,043.02 | 3.29         |
| 4  | 113037 | 紫银转债  | 10,984,694.18 | 3.05         |
| 5  | 128137 | 洁美转债  | 4,811,984.26  | 1.33         |
| 6  | 127045 | 牧原转债  | 3,902,861.04  | 1.08         |
| 7  | 110067 | 华安转债  | 3,539,829.71  | 0.98         |
| 8  | 118021 | 新致转债  | 3,018,148.84  | 0.84         |
| 9  | 110087 | 天业转债  | 2,108,182.21  | 0.58         |
| 10 | 113064 | 东材转债  | 1,835,071.38  | 0.51         |
| 11 | 110089 | 兴发转债  | 1,732,897.88  | 0.48         |
| 12 | 128105 | 长集转债  | 1,595,779.59  | 0.44         |
| 13 | 127078 | 优彩转债  | 1,501,638.50  | 0.42         |
| 14 | 128136 | 立讯转债  | 1,486,832.49  | 0.41         |
| 15 | 113049 | 长汽转债  | 1,463,849.91  | 0.41         |
| 16 | 113627 | 太平转债  | 1,405,169.78  | 0.39         |
| 17 | 113650 | 博22转债 | 1,231,754.20  | 0.34         |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 18 | 123115 | 捷捷转债 | 765,070.14 | 0.21 |
| 19 | 128074 | 游族转债 | 436,784.95 | 0.12 |
| 20 | 118033 | 华特转债 | 224,175.24 | 0.06 |
| 21 | 123109 | 昌红转债 | 92,862.24  | 0.03 |

### 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 开放式基金份额变动

单位：份

|                               | 财通收益增强债券A     | 财通收益增强债券C      |
|-------------------------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 55,164,314.33 | 229,364,881.99 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 3,998,036.00  | 329,480.79     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 7,760,788.95  | 1,049,491.00   |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -             | -              |
| 报告期期末基金份额总额                   | 51,401,561.38 | 228,644,871.78 |

注：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。

## §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

本基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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 | 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 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比 |

|   |   |                       |               |      |      |               |        |
|---|---|-----------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
| 别   |   | 达到或者超过20%的时间区间        |               |      |      |               |        |
| 机构  | 1 | 2023-07-01至2023-09-30 | 61,530,238.96 | 0.00 | 0.00 | 61,530,238.96 | 21.97% |
| 产品特有风险  |   |                       |               |      |      |               |        |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |   |                       |               |      |      |               |        |

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §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、财通收益增强债券型证券投资基金基金合同；
- 3、财通收益增强债券型证券投资基金托管协议；
- 4、财通收益增强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43/45楼。

### 9.3 查阅方式

投资者可在本基金管理人网站上免费查阅备查文件，对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

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  
二〇二三年十月二十五日