

**财通可转债债券型证券投资基金2021年第2季度报告**

**2021年06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:2021年07月20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7月19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2021年4月1日起至6月30日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 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   |
| 基金合同生效日    | 2020年10月20日   |
| 报告期末基金份额总额 | 37,907,217.59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       | 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， |

|                 |  |   |
|-----------------|--|---|
|                 | <p>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，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 | 31,195,926.97份   | 6,711,290.62份   |
| 下属分级基金的风险收益特征   | <p>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。</p>  | <p>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。</p> |

注：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(2021年04月01日 - 2021年06月30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      | 298,189.35                     | 30,740.02    |
| 2.本期利润         | 2,267,803.30                   | 338,717.05   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1192                         | 0.3135       |
| 4.期末基金资产净值     | 36,548,576.70                  | 8,313,831.02 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.1716                         | 1.2388       |

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。

### 3.2 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   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 8.26%  | 0.58%     | 3.97%      | 0.35%         | 4.29% | 0.23% |
| 过去六个月      | 8.33%  | 0.92%     | 3.38%      | 0.51%         | 4.95% | 0.41% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.09% | 0.86%     | 4.73%      | 0.50%         | 9.36% | 0.36% |

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   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 8.15%  | 0.58%     | 3.97%      | 0.35%         | 4.18% | 0.23% |
| 过去六个月      | 8.12%  | 0.92%     | 3.38%      | 0.51%         | 4.74% | 0.41% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.77% | 0.86%     | 4.73%      | 0.50%         | 9.04% | 0.36% |

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)本基金自 2020 年 10 月 20 日转型为财通可转债债券型证券投资基金；

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

### 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



注：(1)本基金自 2020 年 10 月 20 日转型为财通可转债债券型证券投资基金；  
(2)本基金建仓期是合同生效日起 6 个月，截至建仓期末及本报告期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

## §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 | 2018-09-14  | -    | 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                    | 2020-05-14  | -    | 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<br>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

今年二季度债市走出了慢牛行情。10年国债收益率从3.19%下行至3.07%，10年国开收益率从3.57%下行至3.49%，国债和国开分别下行12bp和8bp，季内利率波动不大，平稳下行。基本面角度看，国内经济持续复苏，但由于去年基数原因，表观增速呈现冲高回落态势。最新数据显示，生产端工业增加值同比小幅回落，表现较为平稳。需求端出口有所回落，地产投资维持高位，制造业投资延续改善。整体二季度经济动能强于一季度，生产保持平稳，消费持续恢复，出口、制造业投资及地产投资对经济存在一定的支撑。货币政策方面，上半年货币政策始终保持正常化，维持银行间流动性平衡，资金面利率整体在上半年呈现逐步下行态势，除在传统季末时点有所波动外，整体平稳运行。由于国内经济内生增长动力仍有待明确，结构性政策十分必要，因此宽松政策很难完全退出。操作方面，本基金在2季度较为积极地参与权益市场，在行业配置上相对均衡，适当偏向于新能源、科技和周期板块。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通可转债债券A基金份额净值为1.1716元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.26%，同期业绩比较基准收益率为3.97%；截至报告期末财通可转债债券C基金份额净值为1.2388元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.15%，同期业绩比较基准收益率为3.97%。

#### 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；本基金转型后资产净值于2020年10月20日至2021年6月30日期间连续171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



### 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<br>(%) |
|----|-----------------------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资                  | 7,175,295.00  | 15.33            |
|    | 其中：股票                 | 7,175,295.00  | 15.33            |
| 2  | 基金投资                  | -             | -                |
| 3  | 固定收益投资                | 38,156,812.30 | 81.51            |
|    | 其中：债券                 | 38,156,812.30 | 81.51            |
|    | 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<br>返售金融资产 | -             | -                |
| 7  | 银行存款和结算备付金合<br>计      | 1,367,145.18  | 2.92             |
| 8  | 其他资产                  | 111,625.14    | 0.24             |
| 9  | 合计                    | 46,810,877.62 | 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                   | 5,859,803.00 | 13.06        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生<br>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           | 925,362.00   | 2.06         |
| H  | 住宿和餐饮业                | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技<br>术服务业   | -            | -            |
| J  | 金融业                   | -            | -            |

|   |               |              |       |
|---|---------------|--------------|-------|
| K | 房地产业          | -            | -     |
| L | 租赁和商务服务业      | 390,130.00   | 0.87  |
| 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            | 7,175,295.00 | 15.99 |

### 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  | 300750 | 宁德时代 | 2,400  | 1,283,520.00 | 2.86          |
| 2  | 601919 | 中远海控 | 30,300 | 925,362.00   | 2.06          |
| 3  | 300896 | 爱美客  | 1,000  | 788,880.00   | 1.76          |
| 4  | 603893 | 瑞芯微  | 4,900  | 683,354.00   | 1.52          |
| 5  | 002371 | 北方华创 | 2,300  | 637,974.00   | 1.42          |
| 6  | 002709 | 天赐材料 | 4,900  | 522,242.00   | 1.16          |
| 7  | 605499 | 东鹏饮料 | 2,000  | 501,600.00   | 1.12          |
| 8  | 601012 | 隆基股份 | 4,900  | 435,316.00   | 0.97          |
| 9  | 000683 | 远兴能源 | 91,200 | 425,904.00   | 0.95          |
| 10 | 601888 | 中国中免 | 1,300  | 390,130.00   | 0.87          |

### 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 | 2,368,319.10 | 5.28          |

|    |           |               |       |
|----|-----------|---------------|-------|
| 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） | 35,788,493.20 | 79.77 |
| 8  | 同业存单      | -             | -     |
| 9  | 其他        | -             | -     |
| 10 | 合计        | 38,156,812.30 | 85.05 |

### 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  | 110053 | 苏银转债   | 20,450 | 2,481,812.00 | 5.53         |
| 2  | 019645 | 20国债15 | 23,610 | 2,368,319.10 | 5.28         |
| 3  | 110079 | 杭银转债   | 17,620 | 2,006,389.40 | 4.47         |
| 4  | 113611 | 福20转债  | 11,290 | 1,942,896.10 | 4.33         |
| 5  | 123111 | 东财转3   | 13,260 | 1,940,733.60 | 4.33         |

**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   | 5,066.37   |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 99,779.77  |
| 5  | 应收申购款   | 6,779.00   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 111,625.14 |

### 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  | 110053 | 苏银转债   | 2,481,812.00 | 5.53         |
| 2  | 113611 | 福20转债  | 1,942,896.10 | 4.33         |
| 3  | 132018 | G三峡EB1 | 1,937,535.60 | 4.32         |
| 4  | 113582 | 火炬转债   | 1,847,778.00 | 4.12         |
| 5  | 128095 | 恩捷转债   | 1,817,524.80 | 4.05         |
| 6  | 123090 | 三诺转债   | 1,547,650.00 | 3.45         |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 7  | 128134 | 鸿路转债   | 1,439,419.80 | 3.21 |
| 8  | 113013 | 国君转债   | 1,287,162.10 | 2.87 |
| 9  | 113025 | 明泰转债   | 1,201,426.30 | 2.68 |
| 10 | 110047 | 山鹰转债   | 1,039,529.70 | 2.32 |
| 11 | 128111 | 中矿转债   | 983,035.20   | 2.19 |
| 12 | 123058 | 欣旺转债   | 969,123.00   | 2.16 |
| 13 | 110059 | 浦发转债   | 882,946.60   | 1.97 |
| 14 | 132015 | 18中油EB | 873,215.00   | 1.95 |
| 15 | 113508 | 新风转债   | 841,168.80   | 1.87 |
| 16 | 113605 | 大参转债   | 499,132.80   | 1.11 |
| 17 | 113026 | 核能转债   | 393,315.60   | 0.88 |
| 18 | 110051 | 中天转债   | 354,824.70   | 0.79 |
| 19 | 128119 | 龙大转债   | 348,290.00   | 0.78 |
| 20 | 128017 | 金禾转债   | 316,821.40   | 0.71 |
| 21 | 128046 | 利尔转债   | 196,469.40   | 0.44 |
| 22 | 127020 | 中金转债   | 189,781.00   | 0.42 |
| 23 | 110041 | 蒙电转债   | 175,951.20   | 0.39 |
| 24 | 110068 | 龙净转债   | 172,094.40   | 0.38 |

### 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                   | 16,842,570.34 | 449,952.14   |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 16,284,358.92 | 6,262,362.23 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 1,931,002.29  | 1,023.75     |
| 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                   | 31,195,926.97 | 6,711,290.62 |

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。

## §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内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内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

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。

### 8.2 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、2021年4月2日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海国金理益财富基金销售有限公司为代销机构的公告》；

2、2021年4月10日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宁波银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

3、2021年4月21日披露了《财通可转债债券型证券投资基金2021年第一季度报告》；

4、2021年5月12日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下投资组合调整停牌股票估值方法的公告》；

5、2021年5月14日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加光大证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

6、2021年5月25日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国中金财富证券有限公司为代销机构的公告》；

7、2021年6月18日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券股份有限公司为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》；

8、2021年6月26日披露了《财通基金管理有限公司关于根据〈公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）〉修订旗下部分公募基金基金合同的公告》；

9、2021年6月26日披露了《财通可转债债券型证券投资基金更新招募说明书（2021年6月26日公告）》；

10、2021年6月26日披露了《财通可转债债券型证券投资基金基金合同（2021年6月26日公告）》；

11、2021年6月26日披露了《财通可转债债券型证券投资基金托管协议（2021年6月26日公告）》；

12、2021年6月29日披露了《财通基金管理有限公司关于以通讯方式召开财通可转债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》；

13、2021年6月30日披露了《财通基金管理有限公司关于以通讯方式召开财通可转债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示公告》；

14、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  
二〇二一年七月二十日