

---

财通资管双盈债券型发起式证券投资基金

2022年第4季度报告

2022年12月31日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:华夏银行股份有限公司

报告送出日期:2023年01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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年01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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年10月01日起至12月31日止。

## §2 基金产品概况

|             |   |              |
|-------------|---|--------------|
| 基金简称        | 财通资管双盈债券发起式   |              |
| 基金主代码       | 013097  |              |
| 基金运作方式      | 契约型开放式  |              |
| 基金合同生效日     | 2021年09月24日   |              |
| 报告期末基金份额总额  | 178,756,462.54份                                     |              |
| 投资目标        | 在严格控制风险的基础上，把握市场机会，追求基金资产的稳健增值。                     |              |
| 投资策略        | 1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、股票投资策略；5、国债期货投资策略。 |              |
| 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      | 本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。          |              |
| 基金管理人       | 财通证券资产管理有限公司  |              |
| 基金托管人       | 华夏银行股份有限公司  |              |
| 下属分级基金的基金简称 | 财通资管双盈债券发起式A  | 财通资管双盈债券发起式C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013097  | 013098       |

|                 |                 |                |
|-----------------|-----------------|----------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 165,551,094.33份 | 13,205,368.21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10月01日 - 2022年12月31日) |               |
|----------------|--------------------------------|---------------|
|                | 财通资管双盈债券发起式A                   | 财通资管双盈债券发起式C  |
| 1.本期已实现收益      | -170,855.84                    | -15,412.60    |
| 2.本期利润         | -2,079,943.38                  | -189,698.16   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0124                        | -0.0145       |
| 4.期末基金资产净值     | 168,797,082.10                 | 13,394,866.73 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0196                         | 1.0144        |

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

财通资管双盈债券发起式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      | -1.20% | 0.16%     | -0.32%     | 0.13%         | -0.88% | 0.03% |
| 过去六个月      | -1.30% | 0.15%     | -1.28%     | 0.11%         | -0.02% | 0.04% |
| 过去一年       | -0.34% | 0.16%     | -1.78%     | 0.13%         | 1.44%  | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.96%  | 0.16%     | -1.10%     | 0.12%         | 3.06%  | 0.04% |

财通资管双盈债券发起式C净值表现

| 阶段 | 净值增长 | 净值增长 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

|                | 率①     | 率标准差<br>② | 基准收益<br>率③ | 基准收益<br>率标准差<br>④ |        |       |
|----------------|--------|-----------|------------|-------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -1.30% | 0.16%     | -0.32%     | 0.13%             | -0.98% | 0.03% |
| 过去六个月          | -1.50% | 0.15%     | -1.28%     | 0.11%             | -0.22% | 0.04% |
| 过去一年           | -0.73% | 0.16%     | -1.78%     | 0.13%             | 1.05%  | 0.03% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 1.44%  | 0.16%     | -1.10%     | 0.12%             | 2.54%  | 0.04% |

### 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变动的比较

财通资管双盈债券发起式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



财通资管双盈债券发起式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



注：本基金建仓期为基金合同生效之日起 6 个月，报告期末本基金已建仓完毕。截至建仓期结束，各项资产配置比例符合本基金基金合同约定。

## §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       |        |  |
| 石玉山 | 本基金基金经理和财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金经理。      | 2022-05-05  | -          | 5      | 上海交通大学经济学博士。曾任海通证券资产管理有限公司转债研究员、永赢基金管理有限公司转债研究员，2021年7月加入财通证券资产管理有限公司，曾任固收公募投资部基金经理助理。 |
| 顾宇笛 | 本基金基金经理、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金、财通资 | 2021-09-24  | 2022-11-28 | 8      | 华东师范大学经济学硕士。2014年6月至2014年12月担任财通证券股份有限公司资产管理部债券研究员；2015年1                              |

|     |   |            |            |    |   |
|-----|---|------------|------------|----|---|
|     | 管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金、财通资管鸿盛12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管新添益6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管新聚益6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管双福9个月持有期债券型发起式证券投资基金和财通资管双安债券型证券投资基金基金经理。 |            |            |    | 月至2017年8月担任财通证券资产管理有限公司固定收益部债券研究员，2017年8月起担任基金经理岗位。   |
| 宫志芳 | 本基金基金经理、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金、财通资管稳兴增益六个月持有期混合型证券投资基金、财通资管双福9个月持有期债券型  | 2021-10-19 | 2022-11-25 | 12 | 武汉大学数理金融硕士，中级经济师，2010年7月进入浙江泰隆银行资金运营部先后从事外汇交易和债券交易；2012年3月进入宁波通商银行金融市场部筹备债券业务，主要负责资金、债券投资交易，同时15年初筹备并开展贵金属自营业务；2016年3月加入财通证券资产管理有限公司。 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  | 发起式证券投资基金、财通资管稳兴丰益六个月持有期混合型证券投资基金和财通资管中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理。 |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|

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遵规守信情况的说明

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《财通资管双盈债券型发起式证券投资基金基金合同》、《财通资管双盈债券型发起式证券投资基金招募说明书》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

基本面方面，11、12月受到疫情影响范围扩大的冲击以及外需走弱等方面因素的影响，经济、贸易、金融等相关数据依然偏弱。12月PMI数据明显下探，制造业与非制造业PMI均达到年内最低点，其中制造业5项成分指数除原材料库存外均出现回落，非制造业主要受疫情冲击影响。11月通胀数据仍然维持在相对低位，CPI同比上涨1.6%持平预期，PPI同比回落1.3%低于市场预期，主要系疫情之下内需难以释放以及叠加基数走高等原因。11月出口（美元计）同比减少8.7%，进口（美元计）同比减少10.6%，均低于市场预期；11月金融数据整体低于预期，当月新增社融1.99万亿，同比少增6,109亿元，新增人民币贷款1.21万亿，同比少增600亿，社融存量同比增长10.0%，为有数据统计以来最低，M2受居民存款大幅提升的支撑较前值有所回升；11月社零同比降5.9%，低于市场预期。

政策方面，12月召开的中央经济工作会议延续了“需求收缩、供给冲击、预期转弱”三重压力的判断，强调需要大力提振市场信心，做好“三稳”工作，强调了“扩大内需”的重要性；在货币政策方面，会议强调了“精准有力”、更加注重结构性；在财政方面，提到要保持必要的财政支出强度；同时强调了要加大宏观政策调控力度，加强各类政策协调配合，形成共促高质量发展合力。四季度财政政策方面，12月12日财政部定向发行7500亿元3年期限特别国债；货币政策方面，央行于12月5日下调金融机构存款准备金率0.25个百分点，共计释放长期资金约5000亿元，12月MLF超额等价续作，LPR报价持平上月。地产相关政策方面，11月以来多项支持房地产企业融资的政策陆续落地。

国内方面，近期疫情防控政策不断优化，自疫情防控政策优化的20条以及“新10条”发布后，虽然从部分较早到达峰值的城市来看，其居民出行有所好转，但综合全国来看，疫情影响之下的“弱现实”状态或将延续。

海外方面，美联储、欧洲央行均在12月议息会议上宣布加息50bp，加息幅度同步放缓。美联储主席以及欧央行行长在会后的表态偏强硬，认为短期内仍应该继续加息并且尚不考虑降息。

回顾债券市场，11月以来，在防疫政策优化、房地产支持政策陆续落地的影响下，债市快速、大幅调整，且期间叠加了理财赎回的负反馈影响。纯债操作主要以中高等级债券配置为主，在11月-12月的债市调整过程中，也并未做调整策略：久期方面，在本轮调整之前，已下调债券的加权久期，虽然这轮债市调整超预期，但在确保信用风险无虞、短期回撤可控的基础上，操作上选择了继续持有、承受短期波动；杠杆方面，维持高位，一是因为未通过卖出债券来降低杠杆，二是通过分析债券到期（或回售）情况，预计可在2023年一季度降低杠杆；当然届时会结合债券到期时的市场情况，来确定是否降杠杆、亦或是买入其他性价比更高的短久期债券。

回顾转债市场，2022年四季度转债市场整体呈现震荡下跌的走势，12月以来，随着社会服务、食品饮料等受益于防疫政策优化的价值板块相对强势，可转债指数、中证1000等中小盘指数持续回调，中证转债亦出现明显调整。转债操作上，结构以中低价转债为主、参与了有一定下修预期的转债或下修后性价比改善的转债；仓位略高于中枢水平（中



枢水平约10%)，在债市调整压力最大时，对转债主动减仓至中枢水平，系担心赎回效应波及转债，后随债市企稳，对转债仓位再次进行了回补。

回顾权益市场，2022年四季度，价值优于成长，大盘优于小盘：上证50、沪深300等指数先抑后扬，整体收涨；创业板指、中证1000等指数低位震荡，整体收跌。股票操作上，股票仓位维持在下限，结构以受益于经济复苏的价值板块为主，但因11月以前，价值板块整体弱势，出于止损等因素考虑，仓位有所降低，于12月再次进行回补；权益仓位整体表现逊于市场，有鉴于此（权益市场全年风格切换频繁导致反复止损降仓等），对权益策略进行了改进，采用“核心+卫星”，主要权益仓位放在核心策略，核心策略主要以蓝筹白马股为主，这部分仓位买入持有（经过2022年的持续调整已经具备性价比），不会再做频繁更换；少部分仓位作为卫星策略，拟通过行业轮动来获得行业择时的超额收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管双盈债券发起式A基金份额净值为1.0196元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.20%，同期业绩比较基准收益率为-0.32%；截至报告期末财通资管双盈债券发起式C基金份额净值为1.0144元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.30%，同期业绩比较基准收益率为-0.32%。

#### 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        | 9,643,293.00   | 4.24          |
|    | 其中：股票       | 9,643,293.00   | 4.24          |
| 2  | 基金投资        | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资      | 202,797,742.78 | 89.26         |
|    | 其中：债券       | 202,797,742.78 | 89.26         |
|    | 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 | 14,512,469.34  | 6.39   |
| 8 | 其他资产         | 234,202.12     | 0.10   |
| 9 | 合计           | 227,187,707.24 | 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              | 806,658.00   | 0.44         |
| C  | 制造业              | 5,153,378.00 | 2.83         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 182,700.00   | 0.10         |
| E  | 建筑业              | 172,131.00   | 0.09         |
| F  | 批发和零售业           | -            | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 261,996.00   | 0.14         |
| 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              | 1,993,430.00 | 1.09         |
| K  | 房地产业             | 497,863.00   | 0.27         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 453,637.00   | 0.25         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 121,500.00   | 0.07         |
| 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               | 9,643,293.00 | 5.29         |

### 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  | 300760 | 迈瑞医疗 | 1,200  | 379,164.00 | 0.21          |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 200    | 345,400.00 | 0.19          |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 1,900  | 343,311.00 | 0.19          |
| 4  | 000333 | 美的集团 | 6,300  | 326,340.00 | 0.18          |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 8,700  | 324,162.00 | 0.18          |
| 6  | 601888 | 中国中免 | 1,500  | 324,045.00 | 0.18          |
| 7  | 600887 | 伊利股份 | 10,300 | 319,300.00 | 0.18          |
| 8  | 601658 | 邮储银行 | 68,700 | 317,394.00 | 0.17          |
| 9  | 600309 | 万华化学 | 3,400  | 315,010.00 | 0.17          |
| 10 | 000001 | 平安银行 | 23,400 | 307,944.00 | 0.17          |

### 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      | 11,599,646.79  | 6.37          |
| 2  | 央行票据      | -              | -             |
| 3  | 金融债券      | 15,082,387.40  | 8.28          |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -             |
| 4  | 企业债券      | 43,259,884.71  | 23.74         |
| 5  | 企业短期融资券   | 34,265,740.54  | 18.81         |
| 6  | 中期票据      | 73,059,985.03  | 40.10         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 25,530,098.31  | 14.01         |
| 8  | 同业存单      | -              | -             |
| 9  | 其他        | -              | -             |
| 10 | 合计        | 202,797,742.78 | 111.31        |

### 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 | 2128046   | 21浦发银行02     | 150,000 | 15,082,387.40 | 8.28 |
| 2 | 102103359 | 21陕延油MTN004  | 150,000 | 14,913,983.01 | 8.19 |
| 3 | 101901658 | 19龙城投资MTN001 | 150,000 | 14,739,242.47 | 8.09 |
| 4 | 019656    | 21国债08       | 114,000 | 11,599,646.79 | 6.37 |
| 5 | 012210001 | 22滇池投资SCP002 | 100,000 | 10,163,164.38 | 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**

本基金对国债期货的投资以套期保值为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

**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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局、中国银行保险监督管理委员会的处罚。平安证券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 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   | 33,362.95  |
| 2  | 应收证券清算款 | 199,380.31 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 1,458.86   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 234,202.12 |

### 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  | 113053 | 隆22转债 | 4,000,788.63 | 2.20         |
| 2  | 127033 | 中装转2  | 3,526,429.81 | 1.94         |
| 3  | 110067 | 华安转债  | 3,235,738.36 | 1.78         |
| 4  | 113059 | 福莱转债  | 1,560,719.21 | 0.86         |
| 5  | 110079 | 杭银转债  | 1,394,444.71 | 0.77         |
| 6  | 113519 | 长久转债  | 1,150,569.86 | 0.63         |
| 7  | 127049 | 希望转2  | 1,113,286.03 | 0.61         |
| 8  | 123078 | 飞凯转债  | 781,504.27   | 0.43         |

|    |        |       |            |      |
|----|--------|-------|------------|------|
| 9  | 113060 | 浙22转债 | 724,788.66 | 0.40 |
| 10 | 128134 | 鸿路转债  | 602,505.55 | 0.33 |
| 11 | 113632 | 鹤21转债 | 374,397.95 | 0.21 |
| 12 | 128109 | 楚江转债  | 341,065.40 | 0.19 |
| 13 | 127030 | 盛虹转债  | 251,101.73 | 0.14 |
| 14 | 113622 | 杭叉转债  | 250,394.47 | 0.14 |

### 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 开放式基金份额变动

单位：份

|                               | 财通资管双盈债券发起式A   | 财通资管双盈债券发起式C  |
|-------------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 168,982,716.04 | 12,817,555.79 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 329,674.04     | 2,443,202.38  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 3,761,295.75   | 2,055,389.96  |
| 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                   | 165,551,094.33 | 13,205,368.21 |

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

## §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

单位：份

|                  | 财通资管双盈债券发起式A  | 财通资管双盈债券发起式C |
|------------------|---------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,002,000.20 | -            |
| 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<br>额         | 10,002,000.20 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基<br>金总份额比例（%） | 5.60          | - |

## 7.2 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。

## §8 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<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份额<br>承诺持有<br>期限          |
|-----------------|---------------|----------------------|---------------|----------------------|-----------------------------|
| 基金管理人固<br>有资金   | 10,002,000.20 | 5.60%                | 10,002,000.20 | 5.60%                | 自基金合<br>同生效之<br>日起不少<br>于3年 |
| 基金管理人高<br>级管理人员 | -             | -                    | -             | -                    | -                           |
| 基金经理等人<br>员     | -             | -                    | -             | -                    | -                           |
| 基金管理人股<br>东     | -             | -                    | -             | -                    | -                           |
| 其他              | -             | -                    | -             | -                    | -                           |
| 合计              | 10,002,000.20 | 5.60%                | 10,002,000.20 | 5.60%                | -                           |

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、财通资管双盈债券型发起式证券投资基金相关批准文件
- 2、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程
- 3、财通资管双盈债券型发起式证券投资基金托管协议
- 4、财通资管双盈债券型发起式证券投资基金基金合同
- 5、财通资管双盈债券型发起式证券投资基金招募说明书
- 6、本报告期内按照规定披露的各项公告

## 10.2 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

## 10.3 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

2023年01月20日