

---

财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金

2023年第3季度报告

2023年09月30日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

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23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2023年07月01日起至09月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	财通资管瑞享12个月定开混合	
基金主代码	005686	
基金运作方式	契约型、定期开放式	
基金合同生效日	2018年05月29日	
报告期末基金份额总额	1,098,056,718.25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、权证投资策略；6、期货投资策略；7、开放期投资策略。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×10%+中债综合指数收益率×90%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	财通资管瑞享12个月定开混合A	财通资管瑞享12个月定开混合C

下属分级基金的交易代码	005686	015817
报告期末下属分级基金的份额总额	1,097,194,338.25份	862,380.00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(2023年07月01日 - 2023年09月30日)	
	财通资管瑞享12个月定开混合A	财通资管瑞享12个月定开混合C
1.本期已实现收益	7,958,897.91	8,339.21
2.本期利润	6,778,941.96	7,401.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.0086
4.期末基金资产净值	1,453,446,756.48	1,153,116.80
5.期末基金份额净值	1.3247	1.3371

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

财通资管瑞享12个月定开混合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	0.47%	0.13%	-0.37%	0.08%	0.84%	0.05%
过去六个月	1.08%	0.12%	-0.04%	0.08%	1.12%	0.04%
过去一年	3.44%	0.12%	0.36%	0.10%	3.08%	0.02%
过去三年	19.27%	0.21%	2.27%	0.12%	17.00%	0.09%
过去五年	34.12%	0.18%	8.23%	0.12%	25.89%	0.06%
自基金合同	36.84%	0.17%	7.98%	0.13%	28.86%	0.04%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

财通资管瑞享12个月定开混合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	0.64%	0.13%	-0.37%	0.08%	1.01%	0.05%
过去六个月	1.44%	0.12%	-0.04%	0.08%	1.48%	0.04%
过去一年	4.16%	0.12%	0.36%	0.10%	3.80%	0.02%
自基金合同生效起至今	6.03%	0.13%	0.23%	0.10%	5.80%	0.03%

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

财通资管瑞享12个月定开混合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  
(2018年05月29日-2023年09月30日)



财通资管瑞享12个月定开混合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



## §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		
顾宇笛	本基金基金经理、财通资管鸿盛12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管双安债券型证券投资基金、财通资管双福9个月持有期债券型发起式证券投资基金、财通资	2018-05-29	-	9	硕士研究生学历、硕士学位。曾在财通证券股份有限公司工作。2014年12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，现任固收公募投资部基金经理。

	管新聚益6个月持有期混合型发起式证券投资基金和财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金基金经理。				
陈希希	本基金基金经理、财通资管鸿安30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管鸿启90天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管鸿商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、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金和财通资管现金聚财货币市场基金基金经理。	2023-05-19	-	12	本科学历、学士学位。曾在中盛致远投资管理有限公司、上海嘉航电气有限公司、日信证券有限责任公司、财通证券股份有限公司工作。2014年12月加入财通证券资产管理有限公司，曾任固定收益部高级交易员、固收私募投资部高级研究员、固收私募投资部投资主办，现任固收公募投资部基金经理。
石玉山	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、财通资管双安债券型证券投资基金、财通资管双盈债券型发起式证券投资基金、财通资管稳兴增益六个月持有期混合型证券投资基金、财通资管鑫	2023-09-22	-	5	博士研究生学历、博士学位。曾在上海海通证券资产管理有限公司、永赢基金管理有限公司工作。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，现任固收公募投资部基金经理。

	锐回报混合型证券投资基金和财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金基金经理。				
周庆	本基金基金经理、财通资管鸿安30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金和财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。	2022-08-16	2023-09-27	7	硕士研究生学历、硕士学位。曾在中国银行上海市分行、上海基煜基金销售有限公司工作。2016年3月加入财通证券资产管理有限公司，曾任固收私募投资部高级产品经理、固收研究部高级研究员、固收私募投资部投资经理助理，现任固收公募投资部副总经理。

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《财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》、《财通资管瑞享12个月定期开放混合型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

从基本面来看，三季度随着各项政策逐步落地，经济指标有所改善。8月PMI环比修复，制造业PMI回升0.4个点至49.7%，新订单PMI环比上升至50.2%，内需整体贡献高于外需。8月CPI和PPI增速双双上行，其中CPI同比转正至0.1%，PPI同比回升至-3.0%，反映出经济运行的边际修复。8月社会融资新增3.12万亿元，同比多增0.65万亿元，存量社融增速9.0%，环比上升0.1%，显现见底企稳。8月末，M2余额286.93万亿元，同比增长10.6%，M1余额67.96万亿元，同比增长2.2%，M0余额10.65万亿元，同比增长9.5%。从9月份各项高频数据来看，工厂生产、建筑施工、房地产销售均呈现弱修复，服务业降温、出口环比仍偏弱。同时，随着房地产政策的加码，二手房市场出现转暖迹象，叠加房贷利率调整，有望带来居民中长期信贷增长改观。

政策方面，7月下旬召开的中央政治局会议指出，当前我国经济运行面临新的困难挑战，要精准有力实施宏观调控，加强逆周期调节和政策储备。财政政策方面，8月财政赤字同比明显回升，地方专项债发行节奏加快。货币政策方面，8月15日，央行宣布降息，7天逆回购利率降10bp，MLF利率降15bp，超市场预期。8月下旬开始，房地产优化政策密集出台，以及特殊再融资债券可能发行用于置换地方隐债，这给债市带来利空扰动。随着这些政策调整效果的逐步显现，下半年我国经济有望呈现温和上升态势。

海外方面，美国9月非农就业人口增加33.6万人，增幅创今年以来最大，高于预期值17万人。就业市场的活力暗示企业对销售前景依然充满信心，但也令通胀继续面临上行压力。美国经济数据表现良好，叠加美联储加息会议释放维持高利率信号，对人民币汇率形成压力。随着后续稳经济政策进一步落地实施，预计国内经济将维持稳中向好的修复态势，后续对人民币的支撑或逐渐增强，同时央行和外管局启用稳汇率工具保障汇率在合理区间内稳定运行。

本基金在报告期内采取中短久期、票息和杠杆策略，配置了优质高性价比的城投债，以提高组合的静态收益，并适辅以利率债、高评级信用债、高评级国股存单等的波段操作，增厚产品收益，力争为投资人创造长期稳健的投资回报。

转债操作：持仓结构较为均衡，在结合基本面判断的前提下，注重价格保护+赔率投资，主要实施临近回售或者到期的博弈策略+识别发行人有下修预期的博弈策略，同时灵活仓位参与新券的上市交易。

权益操作：低仓位运作，主要以转债正股替代为主。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管瑞享12个月定开混合A基金份额净值为1.3247元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.47%，同期业绩比较基准收益率为-0.37%；截至报告期末财通资管瑞享12个月定开混合C基金份额净值为1.3371元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.64%，同期业绩比较基准收益率为-0.37%。

#### 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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### §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	54,252,382.72	2.96
	其中：股票	54,252,382.72	2.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,748,405,564.27	95.25
	其中：债券	1,748,405,564.27	95.25
	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	25,010,821.05	1.36
	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	7,332,528.40	0.40
8	其他资产	511,748.69	0.03
9	合计	1,835,513,045.13	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	42,553,732.72	2.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,051,200.00	0.07
E	建筑业	984,000.00	0.07
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	757,800.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,655,050.00	0.11
J	金融业	6,330,200.00	0.44
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	920,400.00	0.06
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	54,252,382.72	3.73

### 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	002475	立讯精密	80,000	2,385,600.00	0.16
2	600030	中信证券	100,000	2,166,000.00	0.15
3	002891	中宠股份	90,000	2,110,500.00	0.15
4	601211	国泰君安	140,000	2,035,600.00	0.14

5	000807	云铝股份	120,000	1,812,000.00	0.12
6	600362	江西铜业	75,000	1,444,500.00	0.10
7	603345	安井食品	10,000	1,240,000.00	0.09
7	300408	三环集团	40,000	1,240,000.00	0.09
9	002996	顺博合金	100,000	1,157,000.00	0.08
10	601128	常熟银行	155,000	1,134,600.00	0.08

#### 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	70,522,165.76	4.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	135,954,377.54	9.35
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	58,362,573.43	4.01
5	企业短期融资券	580,243,384.62	39.89
6	中期票据	507,425,061.21	34.88
7	可转债（可交换债）	395,898,001.71	27.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,748,405,564.27	120.20

#### 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	230012	23付息国债12	700,000	70,522,165.76	4.85
2	2128045	21中国银行永续债02	600,000	62,646,775.89	4.31
3	042380377	23许昌投资CP001	600,000	60,653,508.20	4.17
4	102380022	23洛阳城乡MTN001	500,000	52,245,561.64	3.59
5	102380934	23豫航空港MTN005	500,000	51,806,803.28	3.56

**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**

本基金对股指期货的投资以套期保值、回避市场风险为主要目的，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行形势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

## **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、回避市场风险为主要目的，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，获取超额收益。

### **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，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局、中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。**

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	36,565.20
2	应收证券清算款	475,183.49
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	511,748.69

### 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	127082	亚科转债	11,162,209.84	0.77
2	127068	顺博转债	10,950,375.34	0.75
3	113600	新星转债	10,085,287.72	0.69
4	110079	杭银转债	9,893,671.64	0.68
5	123144	裕兴转债	9,435,145.36	0.65
6	127077	华宏转债	9,105,383.96	0.63
7	110067	华安转债	8,695,945.89	0.60
8	118024	冠宇转债	7,821,407.50	0.54
9	127049	希望转2	7,651,136.16	0.53
10	123076	强力转债	7,611,912.19	0.52
11	127075	百川转2	7,592,414.59	0.52
12	123168	惠云转债	7,321,288.26	0.50

13	123169	正海转债	6,913,173.32	0.48
14	110047	山鹰转债	6,827,786.30	0.47
15	110080	东湖转债	6,636,849.32	0.46
16	128081	海亮转债	6,549,770.01	0.45
17	128109	楚江转债	6,480,772.81	0.45
18	113641	华友转债	6,357,720.00	0.44
19	128116	瑞达转债	6,238,509.10	0.43
20	113609	永安转债	5,865,120.89	0.40
21	123004	铁汉转债	5,591,469.50	0.38
22	118031	天23转债	5,539,896.85	0.38
23	113631	皖天转债	5,313,247.04	0.37
24	123151	康医转债	5,263,729.77	0.36
25	128125	华阳转债	5,063,411.92	0.35
26	113044	大秦转债	4,709,512.33	0.32
27	123049	维尔转债	4,634,728.68	0.32
28	123160	泰福转债	4,624,611.35	0.32
29	123010	博世转债	4,417,325.72	0.30
30	123128	首华转债	4,274,081.10	0.29
31	118022	锂科转债	4,172,936.99	0.29
32	127076	中宠转2	4,013,491.81	0.28
33	123146	中环转2	4,006,099.16	0.28
34	113532	海环转债	3,442,140.82	0.24
35	110084	贵燃转债	3,384,773.71	0.23
36	127024	盈峰转债	3,228,041.51	0.22
37	113052	兴业转债	3,095,811.78	0.21
38	118026	利元转债	3,064,797.53	0.21
39	127073	天赐转债	3,038,114.32	0.21
40	113054	绿动转债	3,029,811.40	0.21
41	127042	嘉美转债	2,802,088.74	0.19
42	128138	侨银转债	2,794,966.53	0.19
43	123159	崧盛转债	2,711,579.39	0.19
44	128130	景兴转债	2,423,478.36	0.17
45	110076	华海转债	2,419,869.01	0.17

46	113667	春23转债	2,417,803.84	0.17
47	118004	博瑞转债	2,382,301.37	0.16
48	113542	好客转债	2,313,112.95	0.16
49	113606	荣泰转债	2,284,528.77	0.16
50	123056	雪榕转债	1,888,810.15	0.13
51	127078	优彩转债	1,846,351.85	0.13
52	123113	仙乐转债	1,838,621.56	0.13
53	113652	伟22转债	1,800,385.42	0.12
54	128117	道恩转债	1,743,107.67	0.12
55	128097	奥佳转债	1,733,320.68	0.12
56	127034	绿茵转债	1,709,806.76	0.12
57	113050	南银转债	1,705,735.48	0.12
58	128105	长集转债	1,624,985.14	0.11
59	118020	芳源转债	1,458,318.58	0.10
60	118019	金盘转债	1,454,434.04	0.10
61	123177	测绘转债	1,427,513.70	0.10
62	113061	拓普转债	1,323,192.60	0.09
63	123099	普利转债	1,308,148.77	0.09
64	127054	双箭转债	1,272,992.47	0.09
65	113060	浙22转债	1,250,855.62	0.09
66	113619	世运转债	1,248,367.12	0.09
67	123175	百畅转债	1,212,513.15	0.08
68	127052	西子转债	1,208,456.09	0.08
69	113647	禾丰转债	1,197,675.34	0.08
70	123162	东杰转债	1,174,705.46	0.08
71	118006	阿拉转债	1,168,668.49	0.08
72	123179	立高转债	1,160,737.67	0.08
73	128136	立讯转债	1,143,482.98	0.08
74	127033	中装转2	1,065,042.19	0.07
75	113661	福22转债	1,057,185.84	0.07
76	127061	美锦转债	1,012,517.81	0.07
77	123133	佩蒂转债	922,838.66	0.06
78	123141	宏丰转债	895,534.16	0.06

79	113627	太平转债	860,475.73	0.06
80	123158	宙邦转债	654,762.40	0.05
81	113066	平煤转债	634,586.16	0.04
82	127053	豪美转债	631,013.84	0.04
83	110082	宏发转债	630,090.47	0.04
84	113058	友发转债	624,963.70	0.04
85	113639	华正转债	617,795.89	0.04
86	128063	未来转债	615,097.47	0.04
87	113602	景20转债	610,374.66	0.04
88	123088	威唐转债	605,513.70	0.04
89	113662	豪能转债	600,069.18	0.04
90	110093	神马转债	587,786.16	0.04
91	128124	科华转债	586,480.28	0.04
92	127062	垒知转债	577,511.78	0.04
93	113656	嘉诚转债	575,881.51	0.04
94	113644	艾迪转债	570,126.03	0.04
95	113059	福莱转债	564,134.25	0.04
96	113048	晶科转债	562,614.38	0.04
97	113657	再22转债	560,810.96	0.04
98	128119	龙大转债	554,475.07	0.04
99	118023	广大转债	528,410.55	0.04
100	110092	三房转债	345,018.66	0.02
101	123147	中辰转债	284,106.06	0.02

### 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

	财通资管瑞享12个月定 开混合A	财通资管瑞享12个月定 开混合C
--	---------------------	---------------------

报告期期初基金份额总额	1,097,194,338.25	862,380.00
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	1,097,194,338.25	862,380.00

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

本报告期，基金管理人未持有本基金份额。

### 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 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

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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、自2023年7月31日起，本基金的托管费年费率由0.25%调低至0.20%。
- 2、2023年8月4日，胡珍珍同志离任本基金管理人财务负责人，由钱慧同志代任财务负责人。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、财通资管瑞享12个月定期开放混合型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、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金托管协议
- 4、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金基金合同
- 5、财通资管瑞享12个月定期开放混合型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

### 9.2 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新业路中国人寿大厦2幢22层

### 9.3 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：400-116-7888

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10月25日