财通可转债债券型证券投资基金2026年第3季度报告

2026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:2026年10月27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约定，于2026年10月26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2026年07月01日起至2026年09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	46,099,312.35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	本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略。
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	32,656,340.12份	13,442,972.23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。	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。

注：(1)本基金自2017年4月14日起增加收取销售服务费的C类基金份额，原基金份额变更为A类基金份额；

(2)本基金自2020年10月20日起，“财通多策略稳健增长债券型证券投资基金”转型为“财通可转债债券型证券投资基金”。

§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(2026年07月01日 - 2026年09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	-713,228.74	-393,905.46
2.本期利润	-3,907,989.39	-1,632,578.62
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1100	-0.1163
4.期末基金资产净值	38,178,711.98	16,273,967.54
5.期末基金份额净值	1.1691	1.2106

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	-8.75%	0.82%	-6.81%	0.61%	-1.94%	0.21%
过去六个月	4.69%	0.96%	-2.87%	0.70%	7.56%	0.26%
过去一年	1.89%	0.94%	-3.06%	0.72%	4.95%	0.22%
过去三年	26.47%	0.78%	15.67%	0.63%	10.80%	0.15%
过去五年	4.86%	0.75%	12.14%	0.59%	-7.28%	0.16%
自基金合同生效起至今	13.85%	0.78%	22.69%	0.58%	-8.84%	0.20%

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	-8.85%	0.82%	-6.81%	0.61%	-2.04%	0.21%
过去六个月	4.48%	0.96%	-2.87%	0.70%	7.35%	0.26%
过去一年	1.48%	0.94%	-3.06%	0.72%	4.54%	0.22%
过去三年	24.93%	0.78%	15.67%	0.63%	9.26%	0.15%
过去五年	2.79%	0.75%	12.14%	0.59%	-9.35%	0.16%
自基金合同生效起至今	11.18%	0.78%	22.69%	0.58%	-11.51%	0.20%

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





注：(1)本基金转型日为 2020 年 10 月 20 日；
(2)本基金建仓期为自基金合同生效起 6 个月内，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		

吴伟	本基金的基金经理	2023-02-10	-	15年	上海财经大学金融学硕士。历任申万宏源研究所研究员，兴业经济研究咨询股份有限公司研究员，上投摩根基金管理有限公司研究员。2022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，现任固收公募投资部基金经理。

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

(2)非首任基金经理的“任职日期”和“离任日期”分别为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法律法规及行业协会的相关规定。

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遵规守信情况的说明

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运作管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和本基金合同，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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，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。本报告期内，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办法》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现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。本报告期内，未发现本基金存在可能导致利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

基本面方面，三季度宏观经济延续总体平稳、发展向新向优。生产端，工业生产保持平稳，新动能支撑有力，1-8月份工业增加值同比增长5.3%，8月同比增长5.2%，较上月加快0.7个百分点，分门类看，1-8月份，以高技术制造业、数字产品制造业等为代表的新动能领域对全部规模以上工业增加值增长的贡献率超五成；服务业生产平稳增长，1-8月份，全国服务业生产指数同比增长4.7%。需求端，延续外需较快增长、内需较为稳定的格局。货物进出口较快增长，1-8月份货物进出口同比增长17.6%，出口增长14.6%、进口增长22.0%，其中机电产品出口增长21.9%。内需方面，1-8月份社会消费品零售总额同比增长1.1%，服务零售额同比增长4.9%；固定资产投资下降，1-8月份固定资产投资同比下降7.2%，扣除房地产开发的固定资产投资下降4.2%，但高技术产业投资保持平稳增长，其中信息服务业，航空、航天器及设备制造业，电子及通信设备制造业投资分别增长22.7%、14.9%、6.9%；房地产开发投资同比下降19.9%，降幅继续扩大。根据中采咨询数据显示，9月制造业PMI升至50.1%，重返扩张区间。在调查的21个行业中有12个行业PMI高于临界点，比上月增加4个，制造业行业景气面有所扩大。总体来看，三季度经济运行总体平稳，延续动能向新、结构向优的发展态势。

宏观政策方面，7月中央政治局会议分析研究当前经济形势，部署下半年经济工作。会议认为，我国经济呈现动能向新、结构向优的发展态势。同时，要高度重视经济运行中的困难挑战。会议强调实施好更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，充分发挥各项存量政策效能，及时谋划出台务实管用的增量政策，加大逆周期调节力度，加力扩大内需、优化供给。扎实推进“六张网”规划建设。加快现代化产业体系建设，深入实施“人工智能+”行动，发展智能经济新形态，完善人工智能治理体系。

下半年以来，各部门陆续出台政策，地产方面，出台政策涉及房地产信贷改革、现房销售和预售制度改革、居民购房贷款贴息等，此外，通过证监会资本市场支持政策与国家金融监督管理总局五大业务办法的协同联动，引导实现金融资源与房地产良性循环。货币政策方面，中国人民银行调整完善若干货币政策工具，主要包括下调抵押补充贷款（PSL）利率0.25个百分点，扩大抵押补充贷款支持领域，增加科技创新和技术改造再贷款额度2000亿元，增加支农支小再贷款额度5000亿元。财政政策方面，扩大对中小微民营企业的贴息范围，并安排使用地方政府债务结存限额5500亿元，用于提高县区一般公共预算保障能力和支持地方扩大有效投资。

资金面方面，三季度流动性整体维持合理充裕，央行长短工具组合对冲政府债集中供给，资金利率中枢平稳、波动可控，没有出现大幅收紧。

本基金采用指数增强的配置策略，增强部分仓位，采取了相对灵活的行业轮动。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，财通可转债债券A基金份额净值为1.1691元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.75%，同期业绩比较基准收益率为-6.81%；截至本报告期末，财通可转债债券C基金份额净值为1.2106元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.85%，同期业绩比较基准收益率为-6.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未有连续20个工作日出现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	10,148,984.10	16.70
	其中：股票	10,148,984.10	16.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	48,313,969.84	79.52
	其中：债券	48,313,969.84	79.52
	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	2,215,316.36	3.65
8	其他资产	81,638.37	0.13
9	合计	60,759,908.67	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	9,462,890.10	17.38
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	686,094.00	1.26
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	10,148,984.10	18.64

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	002810	山东赫达	84,297	1,702,799.40	3.13
2	688825	长鑫科技	15,830	867,325.70	1.59
3	603259	药明康德	4,100	686,094.00	1.26
4	688498	源杰科技	398	641,974.00	1.18
5	603228	景旺电子	6,200	627,502.00	1.15
6	300570	太辰光	2,800	594,580.00	1.09
7	300395	菲利华	6,200	588,504.00	1.08
8	300757	罗博特科	1,100	586,850.00	1.08
9	600183	生益科技	4,300	558,828.00	1.03

10	301511	德福科技	5,800	552,450.00	1.01

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	3,025,970.96	5.56
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）	45,287,998.88	83.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	48,313,969.84	88.73

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	113052	兴业转债	45,400	5,138,436.68	9.44
2	113042	上银转债	30,590	3,593,499.49	6.60
3	019827	26国债01	30,000	3,025,970.96	5.56
4	113056	重银转债	22,460	2,814,957.95	5.17
5	127030	盛虹转债	17,380	1,953,616.76	3.59

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司、上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到监管部门处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述情况外，**本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未出现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。**

5.11.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约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	39,134.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	42,503.57
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	81,638.37

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	113052	兴业转债	5,138,436.68	9.44
2	113042	上银转债	3,593,499.49	6.60
3	113056	重银转债	2,814,957.95	5.17
4	127030	盛虹转债	1,953,616.76	3.59
5	113648	巨星转债	1,783,091.88	3.27
6	118030	睿创转债	1,683,795.53	3.09
7	123107	温氏转债	1,641,211.44	3.01
8	127088	赫达转债	1,611,735.13	2.96
9	110081	闻泰转债	1,372,751.97	2.52
10	127099	盛航转债	1,318,053.42	2.42
11	113631	皖天转债	1,213,986.76	2.23
12	123158	宙邦转债	1,179,998.63	2.17
13	118031	天23转债	1,134,661.83	2.08
14	123259	锦浪转02	1,074,528.07	1.97
15	118060	瑞可转债	1,040,110.11	1.91
16	113661	福22转债	1,034,979.00	1.90
17	113699	金25转债	1,005,706.95	1.85
18	113054	绿动转债	971,111.13	1.78
19	127060	湘佳转债	951,401.45	1.75
20	123220	易瑞转债	886,012.72	1.63
21	123223	九典转02	881,737.44	1.62
22	127045	牧原转债	872,916.16	1.60
23	113696	伯25转债	864,215.85	1.59
24	110077	洪城转债	855,061.92	1.57
25	118058	微导转债	821,189.78	1.51
26	123255	鼎龙转债	782,239.74	1.44
27	111004	明新转债	752,535.08	1.38
28	123176	精测转2	741,000.52	1.36
29	118050	航宇转债	533,223.78	0.98
30	123122	富瀚转债	505,046.87	0.93
31	113677	华懋转债	503,091.88	0.92

32	118064	联瑞转债	467,911.37	0.86
33	123241	欧通转债	446,151.44	0.82
34	127037	银轮转债	406,492.51	0.75
35	118062	天准转债	400,669.97	0.74
36	118061	茂莱转债	268,670.74	0.49
37	118059	颀中转债	258,965.13	0.48
38	123245	集智转债	258,022.30	0.47
39	118056	路维转债	245,028.66	0.45

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	38,994,886.93	12,465,291.05
报告期期间基金总申购份额	4,462,024.68	16,264,320.01
减：报告期期间基金总赎回份额	10,800,571.49	15,286,638.83
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	32,656,340.12	13,442,972.23

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

本基金本报告期内未有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

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、报告期内披露的各项公告；

6、法律法规要求备查的其他文件。

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：www.ctfund.com

财通基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日