

财通可转债债券型证券投资基金2026年第2季度报告

2026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:2026年07月21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07月20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04月01日起至2026年06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	51,460,177.98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	38,994,886.93份	12,465,291.05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04月01日 - 2026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	4,161,599.46	1,707,640.75
2.本期利润	9,014,227.95	2,729,529.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.1851	0.1574
4.期末基金资产净值	49,962,048.72	16,554,854.31
5.期末基金份额净值	1.2812	1.3281

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	14.73%	1.07%	4.22%	0.78%	10.51%	0.29%
过去六个月	11.49%	1.15%	2.93%	0.85%	8.56%	0.30%
过去一年	24.73%	0.91%	13.51%	0.72%	11.22%	0.19%
过去三年	35.81%	0.76%	23.12%	0.61%	12.69%	0.15%
过去五年	9.35%	0.77%	25.71%	0.59%	-16.36%	0.18%
自基金合同生效起至今	24.76%	0.78%	31.65%	0.58%	-6.89%	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	14.62%	1.07%	4.22%	0.78%	10.40%	0.29%
过去六个月	11.27%	1.15%	2.93%	0.85%	8.34%	0.30%
过去一年	24.24%	0.91%	13.51%	0.72%	10.73%	0.19%
过去三年	34.17%	0.76%	23.12%	0.61%	11.05%	0.15%
过去五年	7.21%	0.77%	25.71%	0.59%	-18.50%	0.18%
自基金合同生效起至今	21.97%	0.78%	31.65%	0.58%	-9.68%	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	-	14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，二季度宏观经济延续总体平稳、稳中有进的发展态势，动能向新、结构向优的特征依然明显。生产端，1-5月份工业增加值同比增长5.4%，其中5月高技术制造业和装备制造业增加值同比高增，对全部规模以上工业增加值增长的贡献率接近八成；服务业生产指数平稳增长。需求端，呈现外需强劲，内需偏弱的格局。1-5月份社会消费品零售总额同比增长1.4%，服务零售额同比增长5.4%；投资呈现结构性分化，1-5月份固定资产投资同比下降4.1%；但高技术产业投资同比增长4.5%，其中集成电路制造业、锂离子电池制造业投资分别增长11%和24.9%；房地产开发投资同比下降16.2%，仍是主要制约因素。外贸韧性持续彰显，5月份货物进出口同比增长22.6%，其中出口增长19.4%、进口增长27.4%。总体来看，二季度经济运行总体平稳、稳中有进，新质生产力加快培育壮大，但国内供强需弱矛盾仍较突出，经济稳中向好基础还需继续巩固。

宏观政策方面，4月中央政治局会议分析研究当前经济形势和经济工作。会议认为，今年以来我国经济起步有力，主要指标好于预期，同时指出经济持续稳中向好的基础还需进一步巩固。会议强调要用好用足宏观政策，持续优化财政支出结构；增强货币政策前瞻性灵活性针对性，保持流动性充裕。会议部署了深入挖掘内需潜力、加快建设现代化产业体系、有效防范化解重点领域风险等重点任务，提出加强水网、新型电网、算力网、新一代通信网、城市地下管网、物流网等“六张网”建设，全面实施“人工智能+”行动，纵深推进全国统一大市场建设，深入整治内卷式竞争。

产业政策持续加码。6月3日，工业和信息化部印发《“人工智能+信息通信”创新发展实施意见（2026—2028年）》，明确未来三年人工智能与信息通信产业融合发展路径，提出到2028年形成30个以上高价值典型场景、城域算力1毫秒时延圈覆盖率不低于75%等发展目标，部署5G-A规模普及、6G技术研发、网络大模型和智能体创新、算力设施体系优化等重点任务，推动信息通信业与人工智能融合赋能千行百业。

资金面方面，二季度流动性整体充裕，资金利率向政策利率合理回归。央行通过多种货币政策工具精准调控，有效平抑了税期、跨月等关键时点的流动性波动，并于6月末首次启动隔夜逆回购操作。

本基金采用指数增强的配置策略。

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1.2812元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为14.73%，同期业绩比较基准收益率为4.22%；截至本报告期末，财通可转债债券C基金份额净值为1.3281元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为14.62%，同期业绩比较基准收益率为4.22%。

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	12,984,225.90	16.95
	其中：股票	12,984,225.90	16.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	57,753,865.11	75.39
	其中：债券	57,753,865.11	75.39
	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	5,667,689.67	7.40
8	其他资产	201,903.87	0.26
9	合计	76,607,684.55	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	10,141,670.90	15.25
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	1,522,749.00	2.29
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	1,319,806.00	1.98
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	12,984,225.90	19.52

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	84,797	2,094,485.90	3.15
2	300408	三环集团	11,400	1,902,660.00	2.86
3	688498	源杰科技	985	1,857,710.00	2.79
4	603259	药明康德	10,600	1,319,806.00	1.98
5	300438	鹏辉能源	12,800	1,060,480.00	1.59
6	300750	宁德时代	2,400	943,224.00	1.42
7	601077	渝农商行	131,100	801,021.00	1.20
8	601963	重庆银行	71,600	721,728.00	1.09
9	002837	英维克	8,900	708,084.00	1.06
10	002709	天赐材料	13,500	694,305.00	1.04

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	3,746,714.27	5.63

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）	54,007,150.84	81.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	57,753,865.11	86.83

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	5,224,979.03	7.86
2	019785	25国债13	37,000	3,746,714.27	5.63
3	113056	重银转债	29,880	3,722,090.20	5.60
4	113042	上银转债	30,590	3,533,953.75	5.31
5	123176	精测转2	4,660	2,503,714.59	3.76

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	74,631.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	127,272.86
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	201,903.87

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	5,224,979.03	7.86
2	113056	重银转债	3,722,090.20	5.60
3	113042	上银转债	3,533,953.75	5.31
4	123176	精测转2	2,503,714.59	3.76

5	127088	赫达转债	1,866,439.50	2.81
6	113648	巨星转债	1,617,143.15	2.43
7	113658	密卫转债	1,569,215.87	2.36
8	123251	华医转债	1,513,585.27	2.28
9	110081	闻泰转债	1,214,439.39	1.83
10	127068	顺博转债	1,213,000.27	1.82
11	123259	锦浪转02	1,208,037.17	1.82
12	127099	盛航转债	1,153,712.33	1.73
13	118060	瑞可转债	1,112,849.69	1.67
14	113632	鹤21转债	1,096,092.93	1.65
15	113631	皖天转债	1,062,760.03	1.60
16	111004	明新转债	1,048,202.84	1.58
17	118031	天23转债	1,027,696.43	1.55
18	113616	韦尔转债	1,026,339.36	1.54
19	123178	花园转债	1,016,014.75	1.53
20	123122	富瀚转债	936,595.07	1.41
21	118058	微导转债	911,092.25	1.37
22	127095	广泰转债	878,584.99	1.32
23	110077	洪城转债	853,832.15	1.28
24	113054	绿动转债	819,436.83	1.23
25	123257	安克转债	806,498.30	1.21
26	111003	聚合转债	798,887.89	1.20
27	127092	运机转债	798,720.85	1.20
28	113699	金25转债	790,484.49	1.19
29	111020	合顺转债	788,736.64	1.19
30	113665	汇通转债	788,467.10	1.19
31	118037	上声转债	778,197.62	1.17
32	123117	健帆转债	776,056.52	1.17
33	113649	丰山转债	775,302.88	1.17
34	111009	盛泰转债	774,484.01	1.16
35	113647	禾丰转债	766,336.27	1.15
36	127060	湘佳转债	762,289.92	1.15
37	127045	牧原转债	759,311.22	1.14

38	123223	九典转02	747,931.87	1.12
39	113696	伯25转债	746,200.00	1.12
40	123220	易瑞转债	744,441.65	1.12
41	118030	睿创转债	692,949.44	1.04
42	127037	银轮转债	687,803.62	1.03
43	113062	常银转债	655,573.71	0.99
44	123188	水羊转债	650,938.12	0.98
45	118053	正帆转债	418,218.35	0.63
46	123158	宙邦转债	369,512.53	0.56

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	59,858,129.61	17,222,897.04
报告期期间基金总申购份额	5,486,466.55	26,735,794.80
减：报告期期间基金总赎回份额	26,349,709.23	31,493,400.79
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	38,994,886.93	12,465,291.05

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
二〇二六年七月二十一日