

财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）

2019年第3季度报告

2019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:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2019年10月23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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 18 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 2019 年 7 月 1 日起至 2019 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	财通资管中证500指数增强（LOF）
场内简称	财通500
基金主代码	169301
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年06月27日
报告期末基金份额总额	52,684,880.26份
投资目标	本基金为中证500指数增强型股票基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为中证500指数增强型股票基金，中证500指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场中小市值公司的整体情况。本基金通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。

业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	财通500	财通500C
下属分级基金场内简称	财通500	-
下属分级基金的交易代码	169301	169302
报告期末下属分级基金的份额总额	35,817,688.51份	16,867,191.75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(2019年07月01日 - 2019年09月30日)	
	财通500增强A	财通500增强C
1. 本期已实现收益	503,512.67	434,232.21
2. 本期利润	-185,719.77	-47,677.72
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0045	-0.0005
4. 期末基金资产净值	35,428,743.31	16,646,829.25
5. 期末基金份额净值	0.9891	0.9869

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、本期已实现收益指本期基金利息收入、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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500增强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	-1.10%	0.60%	-0.16%	1.15%	-0.94%	-0.55%
-------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

财通500增强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	-1.32%	0.60%	-0.16%	1.15%	-1.16%	-0.55%

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500增强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

(2019年06月27日-2019年09月30日)



财通500增强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

(2019年06月27日-2019年09月30日)



- 注：1、本基金合同生效日期为 2019 年 6 月 27 日，截至报告期末，本基金合同生效未
满一年。
2、本基金建仓期为自基金合同生效起的 6 个月，报告期末本基金尚未建仓完毕。
3、自基金合同生效至报告期末，财通 500 增强 A 基金份额净值增长率为-1.09%，同期
业绩比较基准收益率为-0.39%；财通 500 增强 C 基金份额净值增长率为-1.31%，同期业
绩比较基准收益率为-0.39%。

§ 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		
王钟	本基金基金经理。	2019- 06-27	-	8	浙江大学数学学士、硕士， 美国德州大学达拉斯分校 计算机科学博士。曾任职 于浙商证券有限责任公 司、浙商期货有限公司资 产管理部。2015年3月加入 财通证券资产管理有限公司，担任指数和策略投资

					部总经理。
--	--	--	--	--	-------

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行业协会《证券从业人员资格管理办法》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

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《财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》、《财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）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

本基金仍处于建仓期内，我们严格遵守风控要求，谨慎建仓。具体交易上，我们严控各类风格因子的暴露。受贸易战，和本季度热点题材的影响，市场风格切换较快且热点集中度较高，分散化投资的量化模型受到一定的挑战，但我们认为这现象将会在未来一个季度有所扭转，所以会继续按照量化模型，坚持对股票从价值，质量，成长等维度进行评估，在控制跟踪误差的基础之上追求长期稳健的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通500基金份额净值为0.9891元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.10%，同期业绩比较基准收益率为-0.16%；截至报告期末财通500C基金份额净值为0.9869元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.32%，同期业绩比较基准收益率为-0.16%。

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	44,471,289.00	83.02
	其中:股票	44,471,289.00	83.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,696,006.70	5.03
	其中:债券	2,696,006.70	5.03
	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	4,744,388.56	8.86
8	其他资产	1,653,425.44	3.09
9	合计	53,565,109.70	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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(指数投资)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	665,799.00	1.28
B	采矿业	2,418,404.00	4.64
C	制造业	20,247,220.00	38.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,647,841.00	3.16
E	建筑业	769,743.00	1.48

F	批发和零售业	2,673,236.00	5.13
G	交通运输、仓储和邮政业	1,162,140.00	2.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,799,608.00	5.38
J	金融业	713,893.00	1.37
K	房地产业	2,052,751.00	3.94
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	259,200.00	0.50
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	2,000,895.00	3.84
S	综合	351,036.00	0.67
	合计	37,761,766.00	72.51

5.2.2 报告期末（积极投资）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	111,168.00	0.21
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,784,055.00	7.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	221,417.00	0.43
E	建筑业	339,655.00	0.65
F	批发和零售业	574,020.00	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	332,126.00	0.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	219,402.00	0.42
J	金融业	336,677.00	0.65
K	房地产业	456,911.00	0.88

L	租赁和商务服务业	111,276.00	0.21
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	111,936.00	0.21
S	综合	110,880.00	0.21
	合计	6,709,523.00	12.88

5.2.3 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 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

5.3.1 报告期末指数投资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	002463	沪电股份	22,700	556,150.00	1.07
2	600745	闻泰科技	7,300	516,037.00	0.99
3	002384	东山精密	22,200	437,340.00	0.84
4	002465	海格通信	41,800	409,640.00	0.79
5	600642	申能股份	68,700	381,285.00	0.73
6	300088	长信科技	51,000	379,440.00	0.73
7	600143	金发科技	56,500	373,465.00	0.72
8	600801	华新水泥	19,800	373,230.00	0.72
9	002500	山西证券	47,500	372,875.00	0.72
10	600845	宝信软件	10,300	368,328.00	0.71

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600387	海越能源	14,700	123,774.00	0.24
2	603600	永艺股份	10,300	117,935.00	0.23

3	601567	三星医疗	16,400	116,276.00	0.22
4	601369	陕鼓动力	16,500	115,500.00	0.22
5	600248	延长化建	26,100	115,101.00	0.22

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	央行票据	-	-
3	金融债券	2,696,006.70	5.18
	其中：政策性金融债	2,696,006.70	5.18
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,696,006.70	5.18

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	108602	国开1704	26,770	2,696,006.70	5.18

注：本基金本报告期末仅持有上述一只债券。

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

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC1910	IC1910	4	3,949,120.00	-108,277.34	-
公允价值变动总额合计 (元)					-108,277.34
股指期货投资本期收益 (元)					32,230.43
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-108,277.34

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货,将以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析,发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点,使用多头持有策略获取一部分较为明确的超额收益,同时也可以通过剩余的现金应对产品的流动性需求。

本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

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	509,398.92
2	应收证券清算款	1,018,425.67
3	应收股利	-
4	应收利息	48,749.35
5	应收申购款	61,818.90
6	其他应收款	-

7	待摊费用	15032.60
8	其他	-
9	合计	1,653,425.44

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	财通500增强A	财通500增强C
报告期期初基金份额总额	48,891,566.87	222,976,391.58
报告期期间基金总申购份额	10,387,239.64	2,081,567.60
减：报告期期间基金总赎回份额	23,461,118.00	208,190,767.43
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	35,817,688.51	16,867,191.75

注：A类和C类总申购份额不含场内转让买入份额，总赎回份额不含场内转让卖出份额。

§ 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

本报告期末，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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		达到或者超过20%的时间区间					
机构	1	20190806-20190807	20,005,555.00	0.00	20,005,555.00	0.00	0.00%
机构	2	20190808-20190930	0.00	20,005,555.00	0.00	20,005,555.00	37.97%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性风险，从而影响基金的投资运作和收益水平。管理人将在基金运作中加强流动性管理，保持合适的流动性水平，对申购赎回进行合理的应对，防范流动性风险，保障持有人利益。</p>							

注：申购份额含场内转让买入，赎回份额含场内转让卖出。

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、财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）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、财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议
- 4、财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同
- 5、财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）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

上海市浦东新区福山路500号城建国际大厦28楼
浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院B幢办公楼

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本集合计划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

财通证券资产管理有限公司

2019年10月23日