

同泰积极配置 3 个月持有期股票型基金中基金 (FOF)

2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：同泰基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 18 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 17 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 2024 年 4 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) |
| 基金主代码 | 016316 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 11 月 3 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 362,708,515.11 份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于公开募集的证券投资基金，在合理控制风险并保障流动性的前提下，通过积极主动的配置策略，追求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过自上而下的分析，形成对不同大类资产市场的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定权益类资产、固定收益类资产、和现金等的配置比例，并随着市场运行状况以及各类资产风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，力争有效控制基金资产运作风险，提高基金资产风险调整后收益。</p> <p>2、基金配置策略</p> <p>在大类资产配置的基础上，综合运用定量和定性分析，优选符合基金投资目标的权益类及固定收益类证券投资基金。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合全价(总值)指数收益率×10% |

| | | |
|-----------------|---|-------------------------|
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金中基金，预期收益和风险水平高于混合型基金、混合型基金中基金、债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金、货币型基金中基金。 本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 基金管理人 | 同泰基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 | |
| 下属分类基金的基金简称 | 同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) A | 同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) C |
| 下属分类基金的交易代码 | 016316 | 016317 |
| 报告期末下属分类基金的份额总额 | 251,794,955.21 份 | 110,913,559.90 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（2024 年 4 月 1 日—2024 年 6 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|-------------------------|
| | 同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) A | 同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) C |
| 1. 本期已实现收益 | -6,166,129.56 | -2,985,021.10 |
| 2. 本期利润 | 543,829.03 | 255,065.05 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0022 | 0.0021 |
| 4. 期末基金资产净值 | 227,372,437.96 | 99,486,513.67 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9030 | 0.8970 |

注：1、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。

2、以上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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

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

同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) A

| 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 | 0.24% | 0.58% | -0.91% | 0.67% | 1.15% | -0.09% |
| 过去六个月 | -4.40% | 0.93% | 1.41% | 0.81% | -5.81% | 0.12% |
| 过去一年 | -13.47% | 0.80% | -8.11% | 0.79% | -5.36% | 0.01% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | -9.70% | 0.74% | -2.94% | 0.82% | -6.76% | -0.08% |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|

同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) C

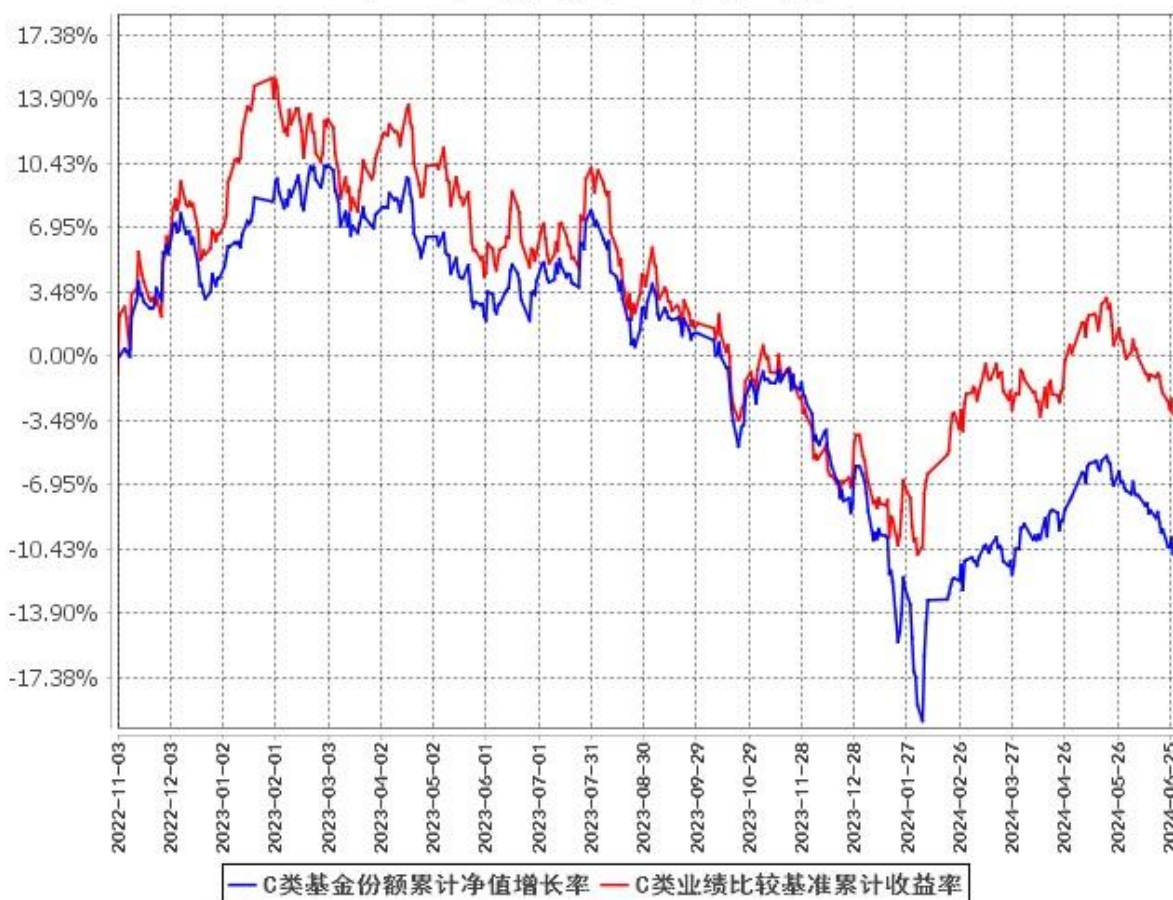
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.16% | 0.58% | -0.91% | 0.67% | 1.07% | -0.09% |
| 过去六个月 | -4.59% | 0.94% | 1.41% | 0.81% | -6.00% | 0.13% |
| 过去一年 | -13.82% | 0.80% | -8.11% | 0.79% | -5.71% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -10.30% | 0.74% | -2.94% | 0.82% | -7.36% | -0.08% |

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

A类基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2022年11月3日至2024年6月30日)



C类基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2022年11月3日至2024年6月30日)



注：本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

3.3 其他指标

无。

§ 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 | | |
| 刘坚 | 本基金基金经理, FOF 投资部总监, 产品开发部总监, 总经理助理 | 2022 年 11 月 3 日 | - | 11 | 刘坚先生, 中国国籍, 硕士。CFA/FRM。曾任恒生银行(中国)有限公司副总裁、宝盈基金管理有限公司产品经理、平安基金管理有限公司产品设计副总 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 监等职。2020 年 6 月加入同泰基金管理有限公司，现任总经理助理、FOF 投资部总监、产品开发部总监、同泰优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理、同泰积极配置 3 个月持有期股票型基金中基金 (FOF) 基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

2、基金的非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指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《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》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

本报告期，无此情况。

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，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和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

报告期内，国内权益指数多数震荡下跌，而国内债券市场表现平稳。股票风格上，大盘价值优

于小盘成长。上证指数下跌 2.43%，沪深 300 指数下跌 2.14%，创业板指数下跌 7.41%，科创 50 指数下跌 6.64%，北证 50 指数下跌 16.18%；港股表现优于 A 股，恒生指数上涨 7.12%；权益策略和行业方面，价值、红利策略相对表现良好，红利指数上涨 1.06%，全指价值指数上涨 3.28%；行业表现上，银行、公用事业、电子、煤炭、交运等板块均有阶段性表现；债券市场方面，资产荒现象延续，债券市场收益率持续下行，受到央行的关注，6 月波动加大。商品方面，贵金属阶段性表现良好。

报告期内，国内出台了一系列经济刺激政策，例如房地产板块相关的放松政策，一定程度上改善了投资者对于经济复苏的预期，但整体而言，我国经济仍然在缓慢复苏过程中，正在经历复杂的内外部环境，复苏的节奏也需要更长时间的验证。消费、投资、出口中的任意一项独立承担“稳增长”的重任都不现实。财政政策上，中央发力节奏仍然偏慢，地方政府的财政和债务问题也成为市场最担忧的因素之一。国际形势的复杂多变，通过汇率传导，加剧了国内权益市场的震荡，后续也将继续影响出口对我国经济的拉动。此外，俄乌问题、巴以问题有所加剧，美国大选正式迎来两党正面交锋的时刻。总体而言，复杂的内外部环境增加了投资者对于经济的担忧。

展望后市，更强有力的财政和货币政策出台或许是资本市场当下的希冀，三中全会等重要会议带来的改革也是市场关注的核心。海外市场上，我们认为复杂的情况可能有阶段性改善。激烈的地缘冲突有望进入尾声，美国降息或许会下半年开启，后续的降息节奏有超预期的概率。但是，我们也必须正视中美、中欧在贸易的摩擦将成为常态的现实。

具体映射到投资市场：A 股仍需等待政策发力及流动性改善，阶段性看好港股投资机会，尤其是高股息及科技成长的哑铃策略；债券市场方面，汇率企稳或许是货币政策进一步发力的前提，短期震荡之后，我们仍然继续看好今年下半年债券市场整体表现；此外，大宗商品仍是关注的重点之一。A 股风格方面，我们继续看好大盘价值。

本产品将继续根据基金合同约定的投资目标，在基金合同约定的投资范围内，优选主动权益类基金构建投资组合，通过不同风格和策略的基金进行均衡配置，力争实现超越业绩比较基准的收益。

本基金将一贯秉承“经得起托付，为信任奉献长期回报”的使命，努力实现长期资产的保值增值，力图成为基金份额持有人长期配置权益类资产的优先选择之一。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) A 的基金份额净值为 0.9030 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.24%；截至本报告期末同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) C 的基金份额净值为 0.8970 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.16%；同期业绩比较基准收益率为 -0.91%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 312,075,270.34 | 93.29 |
| 3 | 固定收益投资 | 17,182,421.64 | 5.14 |
| | 其中：债券 | 17,182,421.64 | 5.14 |
| | 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 | 982,852.41 | 0.29 |
| 8 | 其他资产 | 4,295,145.10 | 1.28 |
| 9 | 合计 | 334,535,689.49 | 100.00 |

注：存放在证券经纪商的证券交易资金账户中的证券交易结算资金统计在“其他资产”内的“存出保证金”项下。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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交易机制投资的港股。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 | 17,182,421.64 | 5.26 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 17,182,421.64 | 5.26 |

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 | 019733 | 24 国债 02 | 170,000 | 17,182,421.64 | 5.26 |

本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

本基金的投资范围不包括股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的投资范围不包括股指期货。

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

本基金的投资范围不包括国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金的投资范围不包括国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金的投资范围不包括国债期货。

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本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期内未持有股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 2,223,007.38 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,038,952.36 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,033,185.36 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 4,295,145.10 |

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

本基金本报告期末未持有股票。

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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 基金中基金

6.1 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基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|----------------|--------|---------------|---------------|--------------|------------------------|
| 1 | 161222 | 国投瑞银瑞利混合(LOF)A | 契约型开放式 | 23,913,545.52 | 54,379,402.51 | 16.64 | 否 |
| 2 | 008270 | 大成睿享 | 契约型开 | 35,834,206.62 | 47,154,232.49 | 14.43 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|----------------------|------------|---------------|---------------|-------|---|
| | | 混合 C | 放式 | | | | |
| 3 | 483003 | 工银精选 平衡混合 | 契约型开 放式 | 71,482,022.50 | 44,754,894.29 | 13.69 | 否 |
| 4 | 010535 | 广发均衡 增长混合 C | 契约型开 放式 | 41,732,434.11 | 42,550,389.82 | 13.02 | 否 |
| 5 | 001882 | 中欧价值 发现混合 E | 契约型开 放式 | 12,692,828.02 | 27,895,028.14 | 8.53 | 否 |
| 6 | 011128 | 华安精致 生活混合 A | 契约型开 放式 | 21,158,135.01 | 26,578,849.20 | 8.13 | 否 |
| 7 | 006624 | 中泰玉衡 价值优选 混合 A | 契约型开 放式 | 11,722,342.01 | 25,919,270.42 | 7.93 | 否 |
| 8 | 009070 | 大成睿鑫 股票 C | 契约型开 放式 | 16,123,201.19 | 18,014,452.69 | 5.51 | 否 |
| 9 | 004355 | 嘉实丰和 灵活配置 混合 A | 契约型开 放式 | 8,361,371.58 | 15,559,676.37 | 4.76 | 否 |
| 10 | 009275 | 融通医疗 保健行业 混合 C | 契约型开 放式 | 3,421,380.73 | 5,015,744.15 | 1.53 | 否 |

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2024 年 4 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 其中：交易及持有基金管理人 以及管理人关联方所管理基金 产生的费用 |
|---------------------------|--|---|
| 当期交易基金产生的申购费 (元) | 39,729.02 | - |
| 当期交易基金产生的赎回费 (元) | 15,961.17 | - |
| 当期持有基金产生的应支付销 售服务费 (元) | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付管 理费 (元) | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付托 管费 (元) | - | - |
| 当期交易所交易基金产生的交 易费用 (元) | 2,167.14 | - |
| 当前交易基金产生的转换费 (元) | 26,249.85 | - |

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) A | 同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) C |
|---------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 249,762,176.98 | 122,369,886.36 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 15,555,419.93 | 2,171,059.93 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 13,522,641.70 | 13,627,386.39 |
| 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 | 251,794,955.21 | 110,913,559.90 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

8.2 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无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 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

本基金本报告期内无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

报告期内，本基金管理人总部注册地址及办公地址已变更为深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城(南区)T2 栋 3302。前述事项已在中国证监会指定的媒介上公告。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、《同泰积极配置 3 个月持有期股票型基金中基金 (FOF) 基金合同》;
- 2、《同泰积极配置 3 个月持有期股票型基金中基金 (FOF) 托管协议》;
- 3、报告期内同泰积极配置 3 个月持有期股票型基金中基金 (FOF) 公告的各项原稿。

10.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的住所或办公场所。

10.3 查阅方式

投资者可登录中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>) 或者基金管理人网站 (www.tongtaiamc.com) 查阅, 或在营业时间内至基金管理人住所或办公场所免费查阅。

同泰基金管理有限公司

2024 年 7 月 18 日