
西藏东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金
(FOF)

2022年第3季度报告

2022年09月30日

基金管理人:西藏东财基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2022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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2022年10月21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2022年7月1日起至2022年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东财均衡配置三个月持有混合发起式(FOF)
基金主代码	015237
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年05月17日
报告期末基金份额总额	23,158,103.20份
投资目标	本基金通过大类资产配置和精选优质基金构建投资组合,在控制投资风险并保持良好流动性的前提下,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。本基金在宏观经济分析基础上,结合政策面、市场资金面,积极把握市场发展趋势,根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况,对股票、债券、基金和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整。</p> <p>2、基金优选策略。主动管理型基金以“基金经理”为主要研究对象,主要选择投资风格稳定、中长期业绩较好、操作上知行合一的基金经理所管理的基金,研究方法上定量、定性相结合。被动管理型基金方面,主要通过对跟踪指数研究、基金跟踪情况两方面进行考量。</p> <p>其他投资策略还包括:股票投资策略、债券投资策略</p>

	略、资产支持证券投资策略。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债总全价指数收益率×50%	
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。</p> <p>本基金还可投资港股通标的股票。本基金投资港股通标的股票的，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还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。</p>	
基金管理人	西藏东财基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东财均衡配置三个月持有混合发起式(FOF)A	东财均衡配置三个月持有混合发起式(FOF)C
下属分级基金的交易代码	015237	015238
报告期末下属分级基金的份额总额	18,504,621.21份	4,653,481.99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(2022年07月01日 - 2022年09月30日)	
	东财均衡配置三个月持有混合发起式(FOF)A	东财均衡配置三个月持有混合发起式(FOF)C
1. 本期已实现收益	-55,018.90	-49,759.40
2. 本期利润	-1,393,317.19	-319,946.72
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0681	-0.0152
4. 期末基金资产净值	17,142,667.65	4,304,338.47
5. 期末基金份额净值	0.9264	0.9250

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、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。

3、本基金基金合同于2022年5月17日生效。

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

东财均衡配置三个月持有混合发起式(FOF)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	-7.48%	0.42%	-7.43%	0.44%	-0.05%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-7.36%	0.35%	-1.49%	0.49%	-5.87%	-0.14%

东财均衡配置三个月持有混合发起式(FOF)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	-7.57%	0.42%	-7.43%	0.44%	-0.14%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-7.50%	0.35%	-1.49%	0.49%	-6.01%	-0.14%

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

东财均衡配置三个月持有混合发起式(FOF)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



东财均衡配置三个月持有混合发起式(FOF)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



注：1、本基金基金合同于 2022 年 5 月 17 日生效。
2、本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 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		
郭志斌	本基金基金经理	2022-05-17	-	7年	上海交通大学统计学硕士。自2015年4月始,先后在上海凯石益正资产管理有限公司、凯石基金管理有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、西藏东财基金管理有限公司担任研究员、投资经理、基金研究负责人、基金经理等职务。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定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》等相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，未发现存在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

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于公平交易管理的相关内部制度规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。公平交易制度规范的范围包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动以及包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，基金管理人公平交易制度执行情况良好，未发现存在违反公平交易管理要求的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于异常交易管理的相关内部制度规定，对本基金的异常交易行为进行监督检查，未发现本基金存在可能导致不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

3季度的权益市场受到俄乌冲突新进展、美联储鹰派加息而引发的全球金融市场动荡影响，整体处于调整期间，成长类和价值类基金整体大多未实现较好的收益。

我们在市场的下跌过程中观察到今年影响金融市场的各项宏观变量其实相对4月底时点并未出现进一步恶化，但市场指数（沪深300为例）却已经回到4月份的相对低位。

综合考虑股债性价比、估值、市场情绪、调整的幅度、企业盈利面的变化等各项因素，判断市场中长期性价比较高，在下跌的过程中采取了相对前期提升仓位和加大战术配置的逆向策略。基金净值在3季度出现了相对前期较大的回撤，我们预期这个位置的买入和持有具有较高的性价比，争取提升投资人后续的持有体验。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2022年9月30日，东财均衡配置三个月持有混合发起式(FOF)A份额净值为0.9264元，报告期内基金份额净值增长率-7.48%，东财均衡配置三个月持有混合发起式(FOF)C份额净值为0.9250元，报告期内基金份额净值增长率为-7.57%，同期业绩比较基准收益率为-7.43%。

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，本基金未发生相关预警情形。

§ 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	19,756,405.16	91.65
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	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	1,799,983.70	8.35
8	其他资产	325.89	0.00
9	合计	21,556,714.75	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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港股通投资股票。

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

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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期没有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 本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	325.89
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	325.89

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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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	006567	中泰星元 灵活配置 混合A	契约型开 放式	1,182,20 4.09	2,729,70 9.24	12.73	否
2	008810	安信民稳 增长混合 C	契约型开 放式	2,025,68 0.23	2,587,40 1.36	12.06	否
3	519674	银河创新 成长混合 A	契约型开 放式	440,121.3 6	2,211,16 9.71	10.31	否
4	009483	鹏华普利 债券A	契约型开 放式	1,709,10 6.68	1,814,72 9.47	8.46	否
5	014064	银华农业 产业股票 发起式C	契约型开 放式	848,126.3 9	1,623,90 7.60	7.57	否
6	001475	易方达国 防军工混 合A	契约型开 放式	753,284.9 0	1,371,73 1.80	6.40	否
7	002207	前海开源 金银珠宝 混合C	契约型开 放式	1,180,24 1.60	1,327,77 1.80	6.19	否
8	159865	国泰中证 畜牧养殖 ETF	交易型开 放式	1,700,00 0.00	1,326,00 0.00	6.18	否
9	373020	上投摩根 双核平衡 混合A	契约型开 放式	509,282.3 1	1,029,20 8.62	4.80	否
10	512880	证券ETF	交易型开 放式	1,180,00 0.00	962,880. 00	4.49	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用2022年07月01日至 2022年09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）	5,796.62	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	59,811.77	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	3,324.52	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	48,474.24	-
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	11,591.13	-
当期交易基金产生的交易费用（元）	2,941.35	-

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，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

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

	东财均衡配置三个月持有混合发起式(FOF)A	东财均衡配置三个月持有混合发起式(FOF)C
--	------------------------	------------------------

报告期期初基金份额总额	21,811,257.42	34,536,004.63
报告期期间基金总申购份额	38,152.50	3,072.04
减：报告期期间基金总赎回份额	3,344,788.71	29,885,594.68
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	18,504,621.21	4,653,481.99

注：其中“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。

§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

单位：份

	东财均衡配置三个月 持有混合发起式(FOF) A	东财均衡配置三个月 持有混合发起式(FOF) C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,003,667.03	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,003,667.03	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	54.06	-

注：1、其中“买入/申购”含红利再投、转换入份额；“卖出/赎回”含转换出份额。
2、本基金于2022年5月17日成立。本公司于2022年4月28日运用自有资金10,001,000.00元认购本基金A类份额10,003,667.03份，认购费用1,000.00元，符合招募说明书规定的认购费率。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

§9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金	10,003,667.03	43.20%	10,003,667.03	43.20%	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,003,667.03	43.20%	10,003,667.03	43.20%	3年

注：仅基金管理人固有资金持有发起份额。

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022-08-18至2022-09-30	10,003,667.03	-	-	10,003,667.03	43.20%
产品特有风险							
<p>本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；（3）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险。</p>							

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予西藏东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）募集注册的文件
- 二、《西藏东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》
- 三、《西藏东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照

六、基金托管人业务资格批件、营业执照

七、中国证监会要求的其他文件

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

西藏东财基金管理有限公司

2022年10月25日