

财通沪深300指数增强型证券投资基金2024年第3季度报告

2024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:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2024年10月24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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月23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07月01日起至2024年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	财通沪深300指数增强
场内简称	-
基金主代码	005850
交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年12月21日
报告期末基金份额总额	417,325,280.96份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，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	本基金的主要投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、固定收益类资产投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货的投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%

风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，跟踪沪深300指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

注：自2022年12月21日起，“财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金”的基金名称变更为“财通沪深300指数增强型证券投资基金”，并正式实施基金转型。

§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07月01日 - 2024年09月30日）
1.本期已实现收益	-18,150,509.05
2.本期利润	71,294,842.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.1616
4.期末基金资产净值	624,523,118.68
5.期末基金份额净值	1.4965

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

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	13.24%	1.46%	15.25%	1.51%	-2.01%	-0.05%
过去六个月	10.73%	1.16%	12.92%	1.19%	-2.19%	-0.03%

过去一年	5.74%	1.05%	8.53%	1.05%	-2.79%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.22%	0.94%	4.82%	0.95%	-0.60%	-0.01%

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)财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效日为2019年1月30日，本基金自2022年12月21日起转型为财通沪深300指数增强型证券投资基金；
(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		
朱海东	量化投资部副总经理（主持工作）、本基金的基金经理	2019-07-16	-	12年	复旦大学基础数学硕士。历任银河基金管理有限公司量化研究员，平安资产管理有限责任公司研究经理。2019年6月加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部

					基金经理、总经理助理（主持工作），现任量化投资部副总经理（主持工作）、基金经理。
郭欣	本基金的基金经理	2024-03-08	-	11年	上海财经大学概率论与数理统计硕士。历任诺德基金管理有限公司研究员，上海翼丰投资管理有限公司量化研究员。2017年11月加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部研究员、投资经理助理、投资经理，现任量化投资部基金经理。

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，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销售机构监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，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，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2024年三季度，国内宏观经济依旧维持弱复苏态势。6月份开始，信贷脉冲持续走弱，我们认为主要原因是私人部门需求疲软，个人和企业信贷乏力。除此之外，M1和M2剪刀差持续收敛，在“手工补息”监管影响逐渐消退后，更多反映的还是实体经济微观活力不足的隐忧。价格方面，供给扰动格局下，CPI小幅回升，但背后并非需求驱动，而受大宗商品疲软表现影响，PPI增速有所下滑，企业盈利改善仍需假以时日。9月下旬开始由于对政策刺激预期转变和情绪改善，市场出现了大幅的自发性反弹，收益波动也随之加大。

海外方面，市场博弈焦点主要聚焦于今年整体降息幅度。9月份美联储降息落地，表态继续维持“数据依赖”式降息。从9月份美国就业数据来看，我们认为在美债利率上，短期内或难以大幅下行。

本报告期内本产品按照既定的投资策略和量化模型进行投资，运作情况整体正常。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，财通沪深300指数增强基金份额净值为1.4965元，本报告期内，基金份额净值增长率为13.24%，同期业绩比较基准收益率为15.25%。

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，本基金未有连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

§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	569,651,125.89	89.43
	其中：股票	569,651,125.89	89.43
2	基金投资	-	-
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	60,159,677.29	9.44
8	其他资产	7,143,901.74	1.12
9	合计	636,954,704.92	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（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	4,839,716.00	0.77
B	采矿业	22,430,912.18	3.59
C	制造业	234,998,929.95	37.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,709,105.10	3.00
E	建筑业	9,297,829.80	1.49
F	批发和零售业	4,370,705.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	29,280,649.00	4.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,584,337.92	3.62
J	金融业	131,245,020.72	21.02
K	房地产业	3,611,403.00	0.58
L	租赁和商务服务业	4,540,681.19	0.73
M	科学研究和技术服务业	919,881.12	0.15
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	2,783,788.61	0.45

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	489,612,959.59	78.40

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	7,430.00	0.00
B	采矿业	708,643.00	0.11
C	制造业	43,976,149.15	7.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,155,795.40	0.19
E	建筑业	288,772.00	0.05
F	批发和零售业	41,074.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	751,625.00	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	5,764,897.83	0.92
J	金融业	20,444,738.50	3.27
K	房地产业	5,894,255.10	0.94
L	租赁和商务服务业	963.20	0.00
M	科学研究和技术服务业	796,806.12	0.13
N	水利、环境和公共设施 管理业	41,325.00	0.01
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,365.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	164,327.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	80,038,166.30	12.82

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通过港股通机制投资的港股。

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	600519	贵州茅台	10,715	18,729,820.00	3.00
2	601872	招商轮船	2,008,700	16,149,948.00	2.59
3	300750	宁德时代	62,500	15,743,125.00	2.52
4	601318	中国平安	205,600	11,737,704.00	1.88
5	600919	江苏银行	1,224,651	10,287,068.40	1.65
6	000333	美的集团	126,700	9,636,802.00	1.54
7	000001	平安银行	706,800	8,630,028.00	1.38
8	000725	京东方A	1,857,100	8,301,237.00	1.33
9	600030	中信证券	278,375	7,571,800.00	1.21
10	601066	中信建投	276,757	7,433,693.02	1.19

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	002839	张家港行	1,446,000	6,550,380.00	1.05
2	002807	江阴银行	1,500,900	6,423,852.00	1.03
3	603323	苏农银行	1,206,500	6,394,450.00	1.02
4	000729	燕京啤酒	205,600	2,313,000.00	0.37
5	600773	西藏城投	175,562	2,248,955.22	0.36

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**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
IF2412	沪深300股指期 货2412合约	4	4,962,7 20.00	1,189,140.00	-
IF2503	沪深300股指期 货2503合约	5	6,201,9 00.00	1,234,960.00	-
公允价值变动总额合计(元)					2,424,100.00
股指期货投资本期收益(元)					-216,622.61
股指期货投资本期公允价值变动(元)					2,615,493.33

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

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，平安银行股份有限公司、中信证券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	1,339,754.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,804,147.34
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,143,901.74

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600773	西藏城投	2,247,668.22	0.36	非公开发行锁定

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

报告期期初基金份额总额	461,367,005.25
-------------	----------------

报告期期间基金总申购份额	102,078,500.60
减：报告期期间基金总赎回份额	146,120,224.89
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	417,325,280.96

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

报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况发生。

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、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、财通沪深300指数增强型证券投资基金基金合同；
- 3、财通沪深300指数增强型证券投资基金托管协议；
- 4、财通沪深300指数增强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
二〇二四年十月二十四日