

西藏东财慧心优选混合型发起式证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09月30日

基金管理人:西藏东财基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

报告送出日期:2024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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2024年10月22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 | 东财慧心优选混合发起式 |
| 基金主代码 | 019113 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023年10月31日 |
| 报告期末基金份额总额 | 10,130,105.62份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>在大类资产配置方面，本基金通过对国内外宏观经济运行周期、货币和财政政策变化、证券市场走势和估值水平等因素的综合分析，形成对不同大类资产市场表现的判断，在基金合同约定的范围内确定或调整权益类资产、固定收益类资产和现金等大类资产的配置比例。</p> <p>在股票投资方面，在行业配置层面，本基金通过对宏观经济运行趋势、产业环境、产业政策和行业竞争格局等因素的分析，确定宏观及行业经济变量对不同行业的潜在影响，优选具备长期投资价值的核心产业；在个股投资层面，本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方式，对上市公司的投资价值</p> |

| | | |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|
| | 进行综合评估，精选优质个股进行投资。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×20% | |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。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。 | |
| 基金管理人 | 西藏东财基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 广发证券股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 东财慧心优选混合发起式A | 东财慧心优选混合发起式C |
| 下属分级基金的交易代码 | 019113 | 019114 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 10,021,619.96份 | 108,485.66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07月01日 - 2024年09月30日) | |
|----------------|--------------------------------|--------------|
| | 东财慧心优选混合发起式A | 东财慧心优选混合发起式C |
| 1.本期已实现收益 | 80,437.84 | 661.96 |
| 2.本期利润 | 354,518.77 | 4,504.03 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0354 | 0.0390 |
| 4.期末基金资产净值 | 10,894,377.25 | 117,281.79 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0871 | 1.0811 |

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。

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。

3.2 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

东财慧心优选混合发起式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 | 3.37% | 1.20% | 12.80% | 1.20% | -9.43% | 0.00% |
| 过去六个月 | 4.09% | 1.01% | 12.41% | 0.96% | -8.32% | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.71% | 0.78% | 11.65% | 0.86% | -2.94% | -0.08% |

东财慧心优选混合发起式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 | 3.21% | 1.20% | 12.80% | 1.20% | -9.59% | 0.00% |
| 过去六个月 | 3.78% | 1.01% | 12.41% | 0.96% | -8.63% | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.11% | 0.78% | 11.65% | 0.86% | -3.54% | -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

东财慧心优选混合发起式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
(2023年10月31日-2024年09月30日)



东财慧心优选混合发起式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
(2023年10月31日-2024年09月30日)



注：1、本基金基金合同于2023年10月31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 | 离任 | | |
| | | | | | |

| | | 日期 | 日期 | | |
|----|---------|------------|----|------|-------------------------------------------------------------|
| 朱亮 | 本基金基金经理 | 2023-10-31 | - | 6.5年 | 美国密歇根大学应用经济学硕士。历任凯石基金管理有限公司行业研究员，现任西藏东财基金管理有限公司基金经理兼研究员等职务。 |

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。

4.1.1 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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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

2024年前3季度，股票市场跌宕起伏，红利类资产成为市场一条重要投资主线和关注焦点。特别是二季度以来，随着市场整体趋于弱势，成交持续萎缩，大量资金采取防御操作，以高股息、高红利、业绩稳定性强为代表的红利类资产更加受到市场的追捧，这类资产取得了明显的超额收益，成为全市场为数不多的亮眼板块。

随着9月底和国庆前后系列增量政策的出台，市场预期和资金行为出现了新的变化，市场情绪逐步扭转，资金的活跃性和流动性显著增强。偏稳健红利类的资产出现了一定程度的逆风。但从长期看，以红利类资产为代表的业绩稳定、持续增长、具备较强分红能力和意愿的上市公司，仍然属于A股市场中优秀上市公司的代表，仍然具有较强的投资性价比和获取丰厚投资回报的可能。

展望未来，本产品坚持稳健平衡的组合构建思路，以业绩稳健增长有回报和高速增长有空间为两大主轴，集中配置一批具有行业竞争力、业绩持续增长的领军企业。同时注重防范市场风险和大幅波动，加强过程中的仓位管理，尽量控制回撤，及时获利了结，坐实收益，增强投资者的持基体验。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2024年09月30日，东财慧心优选混合发起式A份额净值为1.0871元，报告期内基金份额净值增长率为3.37%，同期业绩比较基准收益率为12.80%；东财慧心优选混合发起式C份额净值为1.0811元，报告期内基金份额净值增长率为3.21%，同期业绩比较基准收益率为12.80%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满3年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于“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”的披露规定。

§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 | 8,295,245.40 | 74.98 |
| | 其中：股票 | 8,295,245.40 | 74.98 |
| 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 | 2,183,775.27 | 19.74 |
| | 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 | 583,750.32 | 5.28 |
| 8 | 其他资产 | - | - |
| 9 | 合计 | 11,062,770.99 | 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 | 2,271,225.00 | 20.63 |
| C | 制造业 | 2,849,980.40 | 25.88 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,174,040.00 | 28.82 |
| 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 | - | - |
| 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 | - | - |
| 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 | 8,295,245.40 | 75.33 |

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

| 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 | 300373 | 扬杰科技 | 15,600 | 708,240.00 | 6.43 |
| 2 | 601899 | 紫金矿业 | 34,500 | 625,830.00 | 5.68 |
| 3 | 601985 | 中国核电 | 52,600 | 586,490.00 | 5.33 |
| 4 | 603993 | 洛阳钼业 | 65,000 | 565,500.00 | 5.14 |
| 5 | 601168 | 西部矿业 | 25,000 | 474,250.00 | 4.31 |
| 6 | 600025 | 华能水电 | 40,000 | 462,000.00 | 4.20 |
| 7 | 002156 | 通富微电 | 19,400 | 444,066.00 | 4.03 |
| 8 | 003816 | 中国广核 | 90,000 | 405,000.00 | 3.68 |
| 9 | 601689 | 拓普集团 | 8,700 | 402,462.00 | 3.65 |
| 10 | 600938 | 中国海油 | 12,900 | 387,645.00 | 3.52 |

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

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，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

| | 东财慧心优选混合发起式A | 东财慧心优选混合发起式C |
|----------------|---------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 10,019,767.94 | 103,582.57 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,873.04 | 41,715.43 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 21.02 | 36,812.34 |

| | | |
|-------------------------------|---------------|------------|
| 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 | 10,021,619.96 | 108,485.66 |

§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

单位：份

| | 东财慧心优选混合发起式A | 东财慧心优选混合发起式C |
|--------------------------|---------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,000,000.00 | 101,930.93 |
| 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 | 10,000,000.00 | 101,930.93 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 99.78 | 93.96 |

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、本基金基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 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 | 10,101,930.93 | 99.72% | 10,000,000.00 | 98.72% | 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 | 10,101,930.93 | 99.72% | 10,000,000.00 | 98.72% | 3年 |

注：仅基金管理人固有资金持有发起份额。

§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

| 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 | 2024-07-01至2024-09-30 | 10,101,930.93 | - | - | 10,101,930.93 | 99.72% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 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。 | | | | | | | |

9.2 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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予西藏东财慧心优选混合型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 二、《西藏东财慧心优选混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 三、《西藏东财慧心优选混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 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

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

10.3 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

2024年10月25日