

同泰数字经济主题股票型证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：同泰基金管理有限公司

基金托管人：国投证券股份有限公司

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。

基金托管人国投证券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 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	同泰数字经济股票
基金主代码	012696
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 7 月 26 日
报告期末基金份额总额	291,174,756.96 份
投资目标	本基金主要投资于与数字经济主题相关的资产，在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求超越基金业绩比较基准的资本增值。
投资策略	1、数字经济主题相关资产界定 本基金主要投资于数字经济主题相关资产。本基金界定的数字经济主题包括数字产业化及产业数字化两大方向，具体指： （1）提供互联网、人工智能、云计算、大数据、新兴软件、移动支付、物联网、量子计算、新材料、新装备、新能源、半导体和集成电路等创新技术、产品及服务的相关产业及公司； （2）受益于技术革新，其主营业务、商业模式、销售渠道、研发及生产方式与科技创新可以交叉融合并促进业务加速发展的消费、金融、交运物流及中上游相关产业及公司； 本基金在投资的过程中，将重点关注符合前述主题界定标准、行业景气度较高、公司基本面良好、商业模式清晰、科研投入较高且估值合理的上市公司。随着经济、技术以及数字经济相关领域的深化改革，本基金将对数字经济主题投资范围

	进行相应调整。若除上述涉及的产业和公司外，其他公司提供的产品或服务符合数字经济投资主题，本基金也将对这些公司进行投资。 2、大类资产配置策略 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固定收益类资产、权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证券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。此外，本基金投资策略还包括：股票投资策略、债券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略。	
业绩比较基准	中证沪港深数字经济主题指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，长期平均风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。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	国投证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	同泰数字经济股票 A	同泰数字经济股票 C
下属分级基金的交易代码	012696	012697
报告期末下属分级基金的份额总额	115,227,571.31 份	175,947,185.65 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 7 月 1 日—2024 年 9 月 30 日）	
	同泰数字经济股票 A	同泰数字经济股票 C
1. 本期已实现收益	-1,235,962.02	-1,965,888.75
2. 本期利润	6,580,001.92	9,876,548.54
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0568	0.0561
4. 期末基金资产净值	68,497,585.52	103,270,324.51
5. 期末基金份额净值	0.5945	0.5869

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

同泰数字经济股票 A

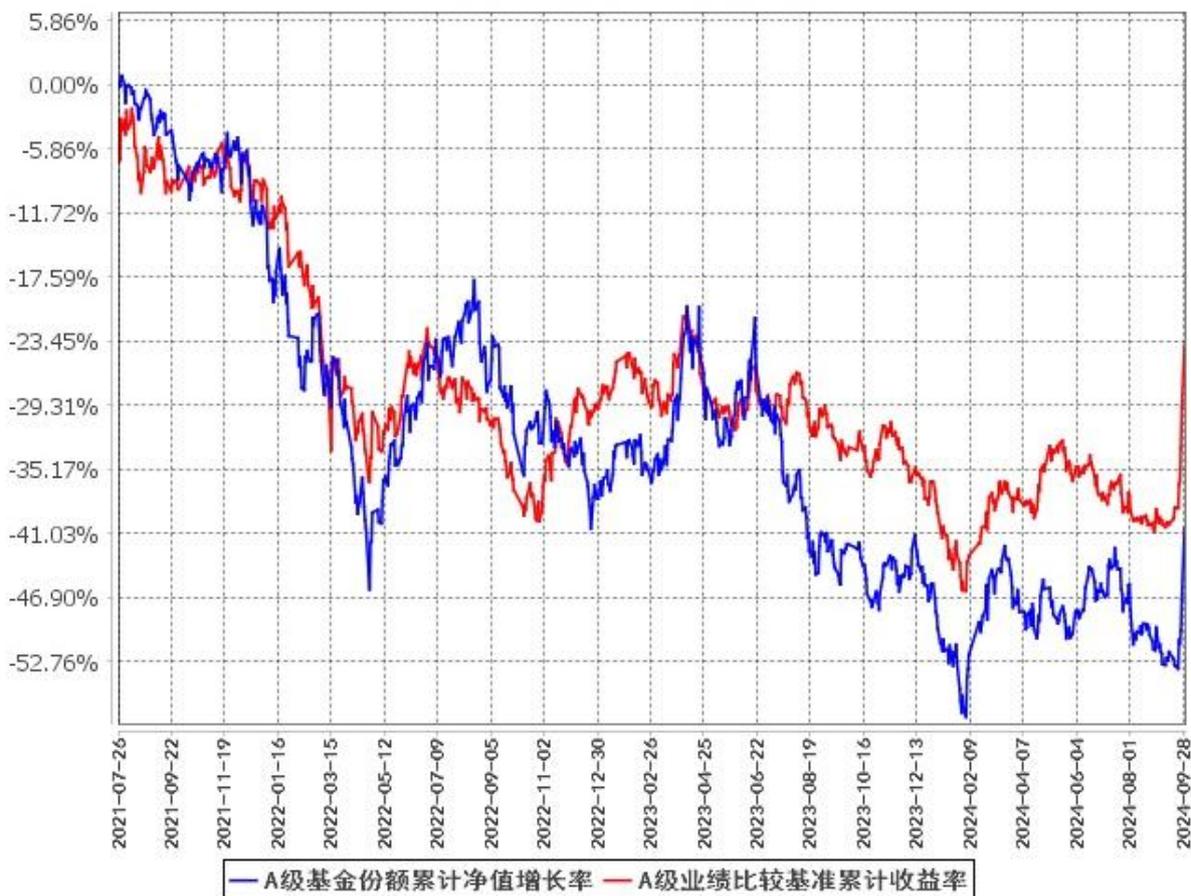
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.71%	2.58%	21.78%	1.68%	-11.07%	0.90%
过去六个月	13.13%	2.23%	22.67%	1.46%	-9.54%	0.77%
过去一年	2.54%	2.19%	13.98%	1.39%	-11.44%	0.80%
过去三年	-35.81%	2.02%	-15.77%	1.42%	-20.04%	0.60%
自基金合同 生效起至今	-40.55%	1.97%	-23.80%	1.42%	-16.75%	0.55%

同泰数字经济股票 C

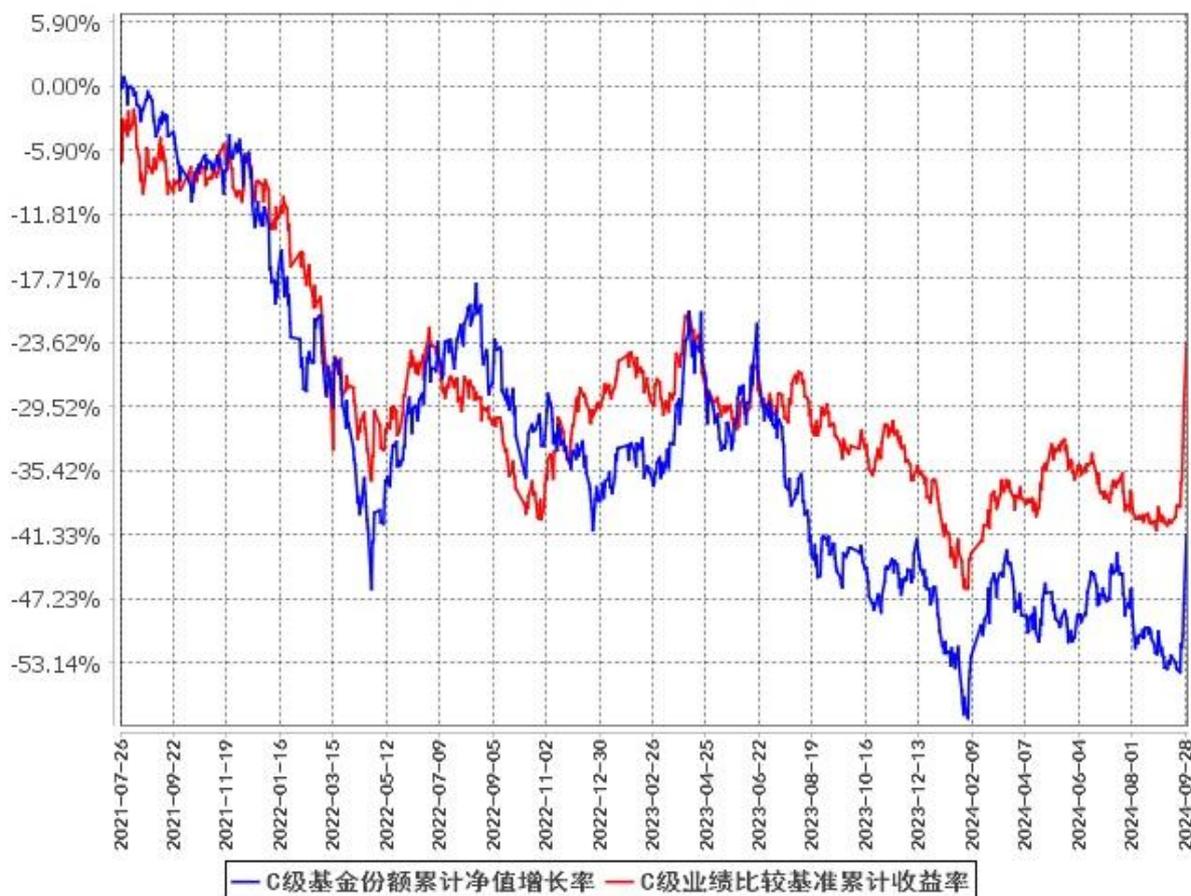
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.57%	2.57%	21.78%	1.68%	-11.21%	0.89%
过去六个月	12.89%	2.23%	22.67%	1.46%	-9.78%	0.77%
过去一年	2.11%	2.18%	13.98%	1.39%	-11.87%	0.79%
过去三年	-36.59%	2.02%	-15.77%	1.42%	-20.82%	0.60%
自基金合同 生效起至今	-41.31%	1.96%	-23.80%	1.42%	-17.51%	0.54%

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级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
(2021年7月26日至2024年9月30日)**



C级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
(2021年7月26日至2024年9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		
陈宗超	本基金基金经理	2021年7月27日	-	10	陈宗超先生，中国国籍，硕士。曾任中芯国际资深芯片研发工程师、超威半导体资深芯片研发工程师、国泰君安研究所分析师、上海盛宇股权投资基

					金管理有限公司投资经理、上海鼎锋明德资产管理有限公司研究总监、南京龙骏投资管理有限公司投资总监、富晨杰芯（天津）科技信息咨询合伙企业投资总监等职。2020 年 6 月加入同泰基金管理有限公司，现任同泰数字经济股票型证券投资基金基金经理、同泰行业优选股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

24 年 3 季度前半段，整体经济依旧偏弱，市场整体情绪较差，成交量处于低位。在减量市场中，板块轮动较快、市场整体的赚钱效应较差。本基金一方面坚守自己的能力圈，另外也在逐步扩张自己的能力圈，争取在未来为投资者创造更佳的投资体验。在科技板块内，本基金大幅提高了选股标准，对长期、中期、短期均较好的个股，提高了集中度，对不符合该标准的个股，快速进行了清仓。同时，利用短期利空的股价下跌，加仓中长期逻辑强的个股。

本基金相信“牛市在绝望中诞生”，且 A 股往往牛短熊长，涨幅反弹最强的几天，往往会给基金的净值带来较大的上涨。在底部区域，逐步增配中证 500 中的优质灰马股。9 月末，在金融政策刺激下，A 股出现了久违的放量急涨。本基金始终保持高仓位，也抓住了本轮上涨行情。

本基金坚持看长做短的策略，对经济和市场的长期判断，是基金投资的基石，是战略问题。而中国经济政策和 A 股走势，往往短期内会有重大的变化，要结合短期的市场情绪和中期的政策走向，进行组合的优化，这是战术问题。战略问题是根本，战术问题是优化，缺一不可。

长期看，中国有全球体量最大、增速很高的制造业基础，有较大的财政刺激和货币刺激的政策空间，有全球战略能力、学习能力、执行力最强的政府，本基金相信百年未有之大变局的到来。而 9 月 24 号政策的拐点信号以及后续市场连续放量上涨，本基金认为，这已经开启了新一轮上行周期。本基金继续高仓位、多赛道布局、精选个股，同时结合市场情绪，适当做高低切换，在牛市中更要坚持自己的风格、保持谨慎。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末同泰数字经济股票 A 的基金份额净值为 0.5945 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.71%；截至本报告期末同泰数字经济股票 C 的基金份额净值为 0.5869 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.57%；同期业绩比较基准收益率为 21.78%。

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	162,022,757.93	94.03
	其中：股票	162,022,757.93	94.03
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	654,726.76	0.38
8	其他资产	9,628,375.00	5.59
9	合计	172,305,859.69	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

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	-	-
C	制造业	152,643,275.01	88.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	9,379,482.92	5.46
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	-	-

0	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	162,022,757.93	94.33

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

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	300502	新易盛	94,200	12,243,174.00	7.13
2	300308	中际旭创	78,000	12,079,080.00	7.03
3	002371	北方华创	28,700	10,503,626.00	6.12
4	300394	天孚通信	102,502	10,301,451.00	6.00
5	002241	歌尔股份	440,800	9,992,936.00	5.82
6	002475	立讯精密	218,400	9,491,664.00	5.53
7	688256	寒武纪	32,437	9,379,482.92	5.46
8	601138	工业富联	321,800	8,106,142.00	4.72
9	002273	水晶光电	426,200	8,067,966.00	4.70
10	688766	普冉股份	92,396	7,575,548.04	4.41

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

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，届时将根据风险管理原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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

在法律法规允许的范围内，本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，投资于国债期货合约，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,214,080.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	414,294.75
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	9,628,375.00
---	----	--------------

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的情况。

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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	同泰数字经济股票 A	同泰数字经济股票 C
报告期期初基金份额总额	117,072,595.03	176,695,083.30
报告期期间基金总申购份额	1,019,603.41	4,420,111.17
减：报告期期间基金总赎回份额	2,864,627.13	5,168,008.82
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	115,227,571.31	175,947,185.65

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。

§ 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

本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
----	----------------	------------

者类别	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	20240701-20240930	87,581,012.44	-	-	87,581,012.44	30.08%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动等风险。

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、《同泰数字经济主题股票型证券投资基金基金合同》；
- 2、《同泰数字经济主题股票型证券投资基金托管协议》；
- 3、报告期内同泰数字经济主题股票型证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所或办公场所。

9.3 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 10 月 24 日