

---

财通资管臻享成长混合型证券投资基金

2024年第2季度报告

2024年06月30日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月19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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年07月16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04月01日起至06月30日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 财通资管臻享成长混合   |
| 基金主代码      | 016605   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2023年03月02日  |
| 报告期末基金份额总额 | 585,911,456.63份  |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略       | 1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、金融衍生品投资策略。                 |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数收益率×75%+中债综合指数收益率×25%   |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。                       |
| 基金管理人      | 财通证券资产管理有限公司   |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司   |

|                 |                 |                 |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 下属分级基金的基金简称     | 财通资管臻享成长混合A     | 财通资管臻享成长混合C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 016605          | 016606          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 471,078,733.24份 | 114,832,723.39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04月01日 - 2024年06月30日) |               |
|----------------|--------------------------------|---------------|
|                | 财通资管臻享成长混合A                    | 财通资管臻享成长混合C   |
| 1.本期已实现收益      | -10,626,317.39                 | -2,667,119.07 |
| 2.本期利润         | 2,927,623.11                   | 631,586.99    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0061                         | 0.0054        |
| 4.期末基金资产净值     | 373,858,871.13                 | 90,649,475.16 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.7936                         | 0.7894        |

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

财通资管臻享成长混合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      | 0.72%   | 1.58%     | -1.32%     | 0.56%         | 2.04%   | 1.02% |
| 过去六个月      | -11.70% | 1.92%     | 1.37%      | 0.67%         | -13.07% | 1.25% |
| 过去一年       | -15.35% | 1.52%     | -6.61%     | 0.65%         | -8.74%  | 0.87% |
| 自基金合同生效起至今 | -20.64% | 1.34%     | -11.17%    | 0.64%         | -9.47%  | 0.70% |

财通资管臻享成长混合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      | 0.62%   | 1.58%     | -1.32%     | 0.56%         | 1.94%   | 1.02% |
| 过去六个月      | -11.88% | 1.92%     | 1.37%      | 0.67%         | -13.25% | 1.25% |
| 过去一年       | -15.68% | 1.52%     | -6.61%     | 0.65%         | -9.07%  | 0.87% |
| 自基金合同生效起至今 | -21.06% | 1.34%     | -11.17%    | 0.64%         | -9.89%  | 0.70% |

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

财通资管臻享成长混合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03月02日-2024年06月30日)



财通资管臻享成长混合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03月02日-2024年06月30日)



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月，报告期末本基金已建仓完毕，截至建仓期结束，各项资产配置比例符合本基金基金合同约定。

## §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 |        |  |
| 陈李 | 本基金基金经理。 | 2023-03-02  | -    | 13     | 硕士研究生学历、硕士学位。曾在上汽集团乘用车分公司、湘财证券股份有限公司、财通证券有限责任公司工作。2015年8月加入财通证券资产管理有限公司，曾任权益私募投资部投资经理，现任权益私募投资部副总经理（主持工作）。 |

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从《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》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

| 姓名 | 产品类型     | 产品数量（只） | 资产净值(元)        | 任职时间       |
|----|----------|---------|----------------|------------|
| 陈李 | 公募基金     | 1       | 464,508,346.29 | 2023-03-02 |
|    | 私募资产管理计划 | 8       | 456,124,883.70 | 2019-04-18 |
|    | 其他组合     | -       | -              | -          |
|    | 合计       | 9       | 920,633,229.99 | -          |

注：陈李于2024年06月24日离任1只私募资产管理计划投资经理的职务。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《财通资管臻享成长混合型证券投资基金基金合同》、《财通资管臻享成长混合型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内，基金运作合法合规，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。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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，本基金与本公司管理的其他基金在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

4月以来，在一季报扰动，社融、生产等经济数据不及预期等影响下，市场波动开始加大。5月内，一方面地产、绿电、半导体等领域政策利好催化不断，另一方面经济增长预期摇摆下多项因素交织，A股震荡调整。但随着6月以来，受持续较弱的经济体感与人民币汇率走势、国内降息预期落空以及中报扰动等因素影响，北向持续流出，市场下行明显。上证指数季度涨跌幅转负，深证、创业板指则进一步走弱，其中价值风格相对占优，银行、公用事业、煤炭等行业本季度依然有上涨，TMT、消费、医药等行业表现不佳。

报告期内，组合一方面以政策为导向，布局了受益于设备更新、以旧换新、地产松绑、节能降碳等政策友善与积极型的行业，如地产、公用事业、机械设备等；另一方面，

组合从政策引导+技术创造新市场视角切入，在受益于电池新技术及组件降本的光伏、国产替代趋势下的半导体设备与材料、AI引领全球硬件需求的消费电子等细分领域持续深耕，行业集中度有所分散，组合稳定度进一步提升。

下一阶段，7月的重要会议后是否会有新一轮政策释放以及前期各类稳增长政策落地的实际效果都有待验证，在市场对经济基本面的预期真正扭转之前，我们将始终保持谨慎态度。我们将在对宏观与中观层面的发展与变化做好预期管理的同时，紧跟政策趋势，加强数据跟踪，进一步完善选股框架，去伪存真，寻找景气度改善逻辑下公司盈利能力有确定性提升的优质个股，以期优化组合，提升胜率。后续如果看到广义财政支出进度加快、地产数据改善、价格上涨持续等边际好转的变化，或可转向积极。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管臻享成长混合A基金份额净值为0.7936元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.72%，同期业绩比较基准收益率为-1.32%；截至报告期末财通资管臻享成长混合C基金份额净值为0.7894元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.62%，同期业绩比较基准收益率为-1.32%。

#### 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              | 428,852,421.87 | 90.52         |
|    | 其中：股票             | 428,852,421.87 | 90.52         |
| 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 | 38,122,647.12  | 8.05   |
| 8 | 其他资产         | 6,796,449.04   | 1.43   |
| 9 | 合计           | 473,771,518.03 | 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              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 378,352,828.13 | 81.45        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 15,501,058.00  | 3.34         |
| 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  | 10,408,088.74  | 2.24         |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| K  | 房地产业             | 7,891,008.00   | 1.70         |
| 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    | 10,661,355.00  | 2.30         |
| 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        | 6,038,084.00   | 1.30         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 428,852,421.87 | 92.32        |

### 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股票。

### 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  | 300751 | 迈为股份 | 353,889   | 42,282,657.72 | 9.10         |
| 2  | 603009 | 北特科技 | 2,272,000 | 40,736,960.00 | 8.77         |
| 3  | 002463 | 沪电股份 | 774,050   | 28,252,825.00 | 6.08         |
| 4  | 300606 | 金太阳  | 1,491,150 | 27,675,744.00 | 5.96         |
| 5  | 300320 | 海达股份 | 2,704,500 | 22,068,720.00 | 4.75         |
| 6  | 603606 | 东方电缆 | 430,278   | 21,001,869.18 | 4.52         |
| 7  | 002475 | 立讯精密 | 420,200   | 16,518,062.00 | 3.56         |
| 8  | 002353 | 杰瑞股份 | 443,800   | 15,568,504.00 | 3.35         |
| 9  | 002938 | 鹏鼎控股 | 363,200   | 14,440,832.00 | 3.11         |
| 10 | 300661 | 圣邦股份 | 167,890   | 13,897,934.20 | 2.99         |

#### 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

本基金本报告期末投资股指期货。

## 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金对股指期货的投资以套期保值为主要目的，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行形势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

## 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

本基金对国债期货的投资以套期保值为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.11.2 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   | 278,220.55   |
| 2  | 应收证券清算款 | 6,453,349.49 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 64,879.00    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 6,796,449.04 |

### 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，各比例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

|                               | 财通资管臻享成长混合<br>A | 财通资管臻享成长混合<br>C |
|-------------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 485,484,401.79  | 118,452,462.06  |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 1,441,971.35    | 1,453,884.78    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 15,847,639.90   | 5,073,623.45    |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -               | -               |
| 报告期期末基金份额总额                   | 471,078,733.24  | 114,832,723.39  |

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

## §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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

### 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申购、赎回、买卖本基金份额。

## §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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、报告期内，经本基金管理人第三届董事会2023年度会议审议通过并按规定备案，周志远先生自2024年04月30日起担任总经理助理。

2、报告期内，本基金管理人北京分公司住所于2024年06月19日变更至北京市西城区金融大街甲9号楼8层801-01单元。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、财通资管臻享成长混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程
- 3、财通资管臻享成长混合型证券投资基金托管协议
- 4、财通资管臻享成长混合型证券投资基金基金合同
- 5、财通资管臻享成长混合型证券投资基金招募说明书
- 6、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 9.2 存放地点

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层  
浙江省杭州市上城区新业路300号中国人寿大厦2幢22层

### 9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：400-116-7888

公司网址：www.ctzg.com

财通证券资产管理有限公司

2024年07月19日