

---

财通中证1000指数增强型证券投资基金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07月18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合同规定，于2024年7月17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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年4月1日起至6月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	财通中证1000指数增强
场内简称	-
基金主代码	019270
交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年11月07日
报告期末基金份额总额	239,853,854.49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基础上，结合增强型的投资方法，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	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金属于指数增强型股票基金，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一</p>

步扩大。

#### (1) 指数投资策略

指数投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整。

#### (2) 指数增强策略

本基金为股票型指数增强基金，主要利用全市场多因子选股模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。

##### 1) 多因子alpha模型——股票超额回报预测

多因子alpha模型以中国股票市场较长期的回测研究为基础，结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金alpha模型的因子可归为如下几类：价值（value）、质量（quality）、动量（momentum）、成长（growth）、市场预期等等。其中，本基金将侧重从基本面投资角度出发，参考市盈率、市净率、市销率、PEG、EV/EBITDA等估值指标，优选价值相对其成长能力被低估的上市公司构成股票池。公司的量化投研团队会持续研究市场的状态以及市场变化，并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。

多因子alpha模型利用长期积累并最新扩展的数据库，科学地考虑了大量的各类信息，包括来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师预测等等多方的信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适合调整各因子类别的具体组成及权重。

##### 2) 风险估测模型——力争有效控制预期风险

本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施，力争有效控制投资组合的预期投资风险，并力求将投资组合的实现风险控制在目标范围内。

##### 3) 交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩

本基金的交易成本模型既考虑固定成本，也考虑交易的市场冲击效应，以力争减少交易对业绩造成的

负面影响。在控制交易成本的基础上，力求进行投资收益的优化。

#### 4) 投资组合的优化和调整

本基金将综合考虑预期回报，风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将包括流动性和基本面信息较好的股票。投资组合构建完成后，本基金将充分考虑各种市场信息的变化情况，对投资组合进行相应调整，并根据市场的实际情况适当控制和调整组合的换手率。

### 2、存托凭证投资策略

本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

### 3、固定收益类资产投资策略

固定收益投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

#### (1) 利率预期与久期控制策略

本基金密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势，在此基础上预测市场利率水平变动趋势，以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。并根据收益率曲线变化情况制定相应的债券组合期限结构策略，如子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

#### (2) 个券选择策略

个券选择层面，对各信用品种进行详细的财务分析和非财务分析后，进行个券选择。财务分析方面，以企业财务报表为依据，对企业规模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行评分；非财务分析方面（包括管理能力、市场地位和发展前景等指标）则主要采取实地调研和电话会议等形式实施。

### (3) 时机策略

i. 价值分析策略。根据当日收益率曲线和债券特性，建立债券的估值模型，对当日无交易的债券计算理论价值，买进价格低于价值的债券；相反，卖出价格高于价值的债券。

ii. 骑乘策略。当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

iii. 息差策略。利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券以获取超额收益。

iv. 利差策略。对两个期限相近的债券的利差进行分析，对利差水平的未来走势做出判断，从而进行相应的债券置换。当预期利差水平缩小时，买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券，通过两债券利差的扩大获得投资收益。

### 4、资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。

### 5、股指期货的投资策略

本基金将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。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期

	<p>货投资时，将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。</p> <p><b>6、股票期权投资策略</b></p> <p>本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> <p><b>7、融资及转融通证券出借业务投资策略</b></p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通证券出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</p> <p>未来，随着投资工具的发展和丰富，基金管理人在履行适当程序后，本基金可在不改变投资目标及风险收益特征的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新。</p>	
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证1000指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%</p>	
<p>风险收益特征</p>	<p>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。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，跟踪中证1000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。</p>	
<p>基金管理人</p>	<p>财通基金管理有限公司</p>	
<p>基金托管人</p>	<p>广发证券股份有限公司</p>	
<p>下属分级基金的基金简称</p>	<p>财通中证1000指数增强 A</p>	<p>财通中证1000指数增强 C</p>
<p>下属分级基金场内简称</p>	<p>-</p>	<p>-</p>

下属分级基金的交易代码	019270	019271
报告期末下属分级基金的份额总额	53,247,581.54份	186,606,272.95份
下属分级基金的风险收益特征	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，跟踪中证1000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。	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，跟踪中证1000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。

### §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)	
	财通中证1000指数增强A	财通中证1000指数增强C
1.本期已实现收益	400,969.26	118,634.13
2.本期利润	-2,561,063.40	-8,997,148.73
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0429	-0.0519
4.期末基金资产净值	46,547,640.51	162,705,480.43
5.期末基金份额净值	0.8742	0.8719

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

财通中证1000指数增强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	-5.27%	1.33%	-9.51%	1.42%	4.24%	-0.09%
过去六个月	-10.26%	1.78%	-15.97%	1.87%	5.71%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-12.58%	1.58%	-18.70%	1.68%	6.12%	-0.10%

财通中证1000指数增强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	-5.36%	1.33%	-9.51%	1.42%	4.15%	-0.09%
过去六个月	-10.45%	1.79%	-15.97%	1.87%	5.52%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-12.81%	1.58%	-18.70%	1.68%	5.89%	-0.10%

注：(1)上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)本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%。

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







注：(1)本基金合同生效日为2023年11月7日，本基金合同生效起至报告期末不满一年；  
(2)本基金建仓期是合同生效日起6个月，截至报告期末和建仓期末，本基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

#### §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	2023-11-07	-	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。
顾弘原	本基金的基金经理	2023-11-07	-	7年	伦敦政治经济学院统计学硕士。历任香港伟享证券有限公司分析师。2017年2月

					加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部助理研究员、研究员，现任量化投资部基金经理。
郭欣	本基金的基金经理	2024-03-08	-	10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

本基金管理人以价值投资为理念，致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系，营造公平交易的执行环境。公司通过严格的内控制度和授权体系，确保投资、研究、交易等各个环节的独立性。公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易，并建立了公平的交易分配制度，确保在场内、场外各类交易中，各投资组合都享有公平的交易执行机会。

同时，公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库，在此平台上共享研究成果，并对各组合提供无倾向性支持；在公用备选库的基础上，各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上，形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中适当启用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节，特殊情况会经过严格的报告和审批程序，会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析，以排查异常交易。

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，未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本投资组合为指数增强型开放式基金。本报告期内，本投资组合的主动型投资部分与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况，也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

经过事前制度约束、事中严密监控，以及事后的统计排查，本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明，本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响，亦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年二季度，国内宏观经济依旧维持弱复苏态势，但动能有所衰弱。3月份开始，信贷脉冲持续走弱，背后一方面是私人部门需求疲软，个人和企业信贷乏力。另一方面，今年财政节奏偏缓，实物工作开展进度偏慢。除此之外，M1和M2剪刀差持续收敛，其中有取消“手工补息”监管的影响，但也有实体微观活力不足的隐忧。从PMI来看，信贷下滑的结果是5、6月份连续两个月略弱于预期的经济扩张幅度。“供强需弱”格局下，今年二季度，国内CPI、PPI整体小幅回升，但“回升”斜率并不陡峭，企业盈利改善较难“一蹴而就”。

海外方面，今年以来市场反复博弈美联储是否会提前降息，但目前美国经济数据依旧不弱，6月份议息会议基本确认美联储将继续维持“Higher for Longer”的货币政策导向。与此同时，近期美国大选风险逐渐进入视野，我们认为这使得短期内美债利率或将继续维持高位。对于国内而言，货币政策在需求走弱的环境下，虽有加码必要，但考虑到内外息差下汇率承压，加之“资金防空转”导向下，我们认为货币政策上进行价格型调控的空间相对有限，结构性货币政策在未来一段时间内或将仍是调控主线。

经济目前仍在持续复苏的脉络上，展望下半年宏观基本面，市场风险与机遇并存。机遇方面，国内政策层面大概率不会“大水漫灌”，而是继续以“固本培元”稳增长为主。我们认为可能的主线有两条：一是专项债发行节奏能否提速，进而形成有效实物工作量，二是“两会”提出的“新质生产力”相关扶持政策辐射范围能否进一步扩增。除此之外，如果海外增长超预期，或美联储超预期提前降息，海外金融条件将有望进一步放松，从而为国内货币政策提供更多空间。风险方面，下半年海外经济增速的放缓和地缘政治摩擦或将通过出口链给国内增长带来一定压力。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，财通中证1000指数增强A基金份额净值为0.8742元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.27%，同期业绩比较基准收益率为-9.51%；截至报告期末，财通中证1000指数增强C基金份额净值为0.8719元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.36%，同期业绩比较基准收益率为-9.51%。

#### 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	190,118,006.57	90.58
	其中：股票	190,118,006.57	90.58
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	16,113,532.97	7.68

8	其他资产	3,653,505.13	1.74
9	合计	209,885,044.67	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	-	-
B	采矿业	6,773,732.80	3.24
C	制造业	113,867,044.50	54.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,062,757.00	3.85
E	建筑业	3,319,266.00	1.59
F	批发和零售业	14,697,456.00	7.02
G	交通运输、仓储和邮政业	5,593,897.00	2.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	9,400,150.72	4.49
J	金融业	3,724,170.00	1.78
K	房地产业	1,026,586.70	0.49
L	租赁和商务服务业	4,179,219.00	2.00
M	科学研究和技术服务业	4,360.30	0.00
N	水利、环境和公共设施 管理业	1,433,715.79	0.69
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	369,210.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	1,349,818.86	0.65
S	综合	-	-
	合计	173,801,384.67	83.06

### 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	-	-
B	采矿业	4,437.00	0.00
C	制造业	9,186,112.61	4.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	59,696.00	0.03
E	建筑业	11,984.00	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,481,003.00	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,715,121.38	1.30
J	金融业	10,633.00	0.01
K	房地产业	973,700.84	0.47
L	租赁和商务服务业	1,049,080.83	0.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,191.24	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	323,232.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	497,430.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	16,316,621.90	7.80

### 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	002267	陕天然气	427,900	3,234,924.00	1.55



2	002745	木林森	262,700	2,117,362.00	1.01
3	300783	三只松鼠	94,400	2,064,528.00	0.99
4	300679	电连技术	48,900	1,967,247.00	0.94
5	002697	红旗连锁	421,400	1,951,082.00	0.93
6	600662	外服控股	481,700	1,931,617.00	0.92
7	000543	皖能电力	216,600	1,916,910.00	0.92
8	301308	江波龙	19,300	1,828,482.00	0.87
9	300428	立中集团	95,700	1,779,063.00	0.85
10	600428	中远海特	288,300	1,764,396.00	0.84

**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	600035	楚天高速	344,500	1,477,905.00	0.71
2	688510	航亚科技	72,789	1,340,045.49	0.64
3	002517	恺英网络	127,300	1,215,715.00	0.58
4	300659	中孚信息	71,084	861,538.08	0.41
5	300612	宣亚国际	67,857	827,176.83	0.40

**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	合约市	公允价值变	风险说明
----	----	-----	-----	-------	------



		(买/卖)	值(元)	动(元)	
IM2407	中证1000股指期货2407合约	2	1,943,200.00	-106,480.00	-
IM2409	中证1000股指期货2409合约	1	956,040.00	-63,560.00	-
IM2412	中证1000股指期货2412合约	4	3,751,200.00	-486,826.67	-
公允价值变动总额合计(元)					-656,866.67
股指期货投资本期收益(元)					632,674.22
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-534,811.76

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将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，参与股指期货交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货交易时，将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 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年收到公开谴责、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	798,052.80

2	应收证券清算款	650,000.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,205,451.63
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,653,505.13

#### 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	300659	中孚信息	861,538.08	0.41	非公开发行锁定
2	300612	宣亚国际	827,176.83	0.40	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

	财通中证1000指数增强 A	财通中证1000指数增强 C
报告期期初基金份额总额	71,024,068.93	177,667,804.52
报告期期间基金总申购份额	2,526,726.25	67,929,827.93
减：报告期期间基金总赎回份额	20,303,213.64	58,991,359.50
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	53,247,581.54	186,606,272.95

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末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末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、财通中证1000指数增强型证券投资基金基金合同；
- 3、财通中证1000指数增强型证券投资基金托管协议；
- 4、财通中证1000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

二〇二四年七月十八日