

同泰优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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 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	同泰优选配置 3 个月持有混合 (FOF)
基金主代码	013849
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 10 月 29 日
报告期末基金份额总额	116,748,308.44 份
投资目标	本基金主要投资于公开募集的证券投资基金，在合理控制风险并保障流动性的前提下，通过积极主动的配置策略，追求基金资产的长期增值。
投资策略	1、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权益类资产、固定收益类资产、和现金等的配置比例，并随着市场运行状况以及各类资产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。 2、基金优选配置策略 在大类资产配置的基础上，综合运用定量和定性分析，优选符合基金投资目标的权益类及固定收益类证券投资基金。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+恒生综合指数收益率×5%+中债综合全价（总值）指数收益率×20%

风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，预期收益和风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金、货币型基金中基金。 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	兴业银行股份有限公司	
下属分类基金的基金简称	同泰优选配置 3 个月持有混合 (FOF) A	同泰优选配置 3 个月持有混合 (FOF) C
下属分类基金的交易代码	013849	013850
报告期末下属分类基金的份额总额	218,460.22 份	116,529,848.22 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）	
	同泰优选配置 3 个月持有混合 (FOF) A	同泰优选配置 3 个月持有混合 (FOF) C
1. 本期已实现收益	3,894.56	1,784,631.75
2. 本期利润	30,886.93	15,418,778.63
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1419	0.1284
4. 期末基金资产净值	181,528.21	95,922,132.77
5. 期末基金份额净值	0.8309	0.8232

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

同泰优选配置 3 个月持有混合 (FOF) 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	19.35%	1.49%	12.98%	1.23%	6.37%	0.26%
过去六个月	19.78%	1.16%	11.81%	0.98%	7.97%	0.18%

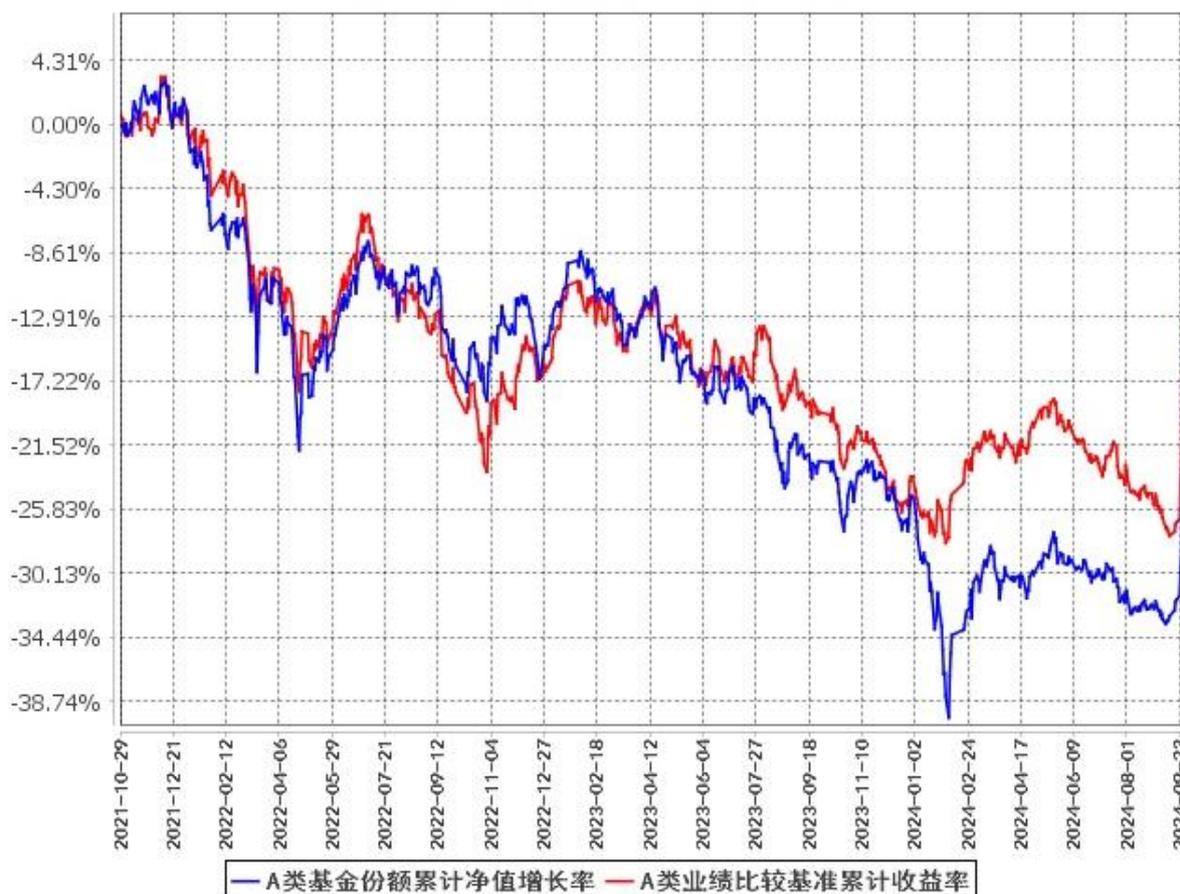
过去一年	7.37%	1.18%	8.51%	0.87%	-1.14%	0.31%
自基金合同生效起至今	-16.91%	1.01%	-12.47%	0.88%	-4.44%	0.13%

同泰优选配置 3 个月持有混合 (FOF) C

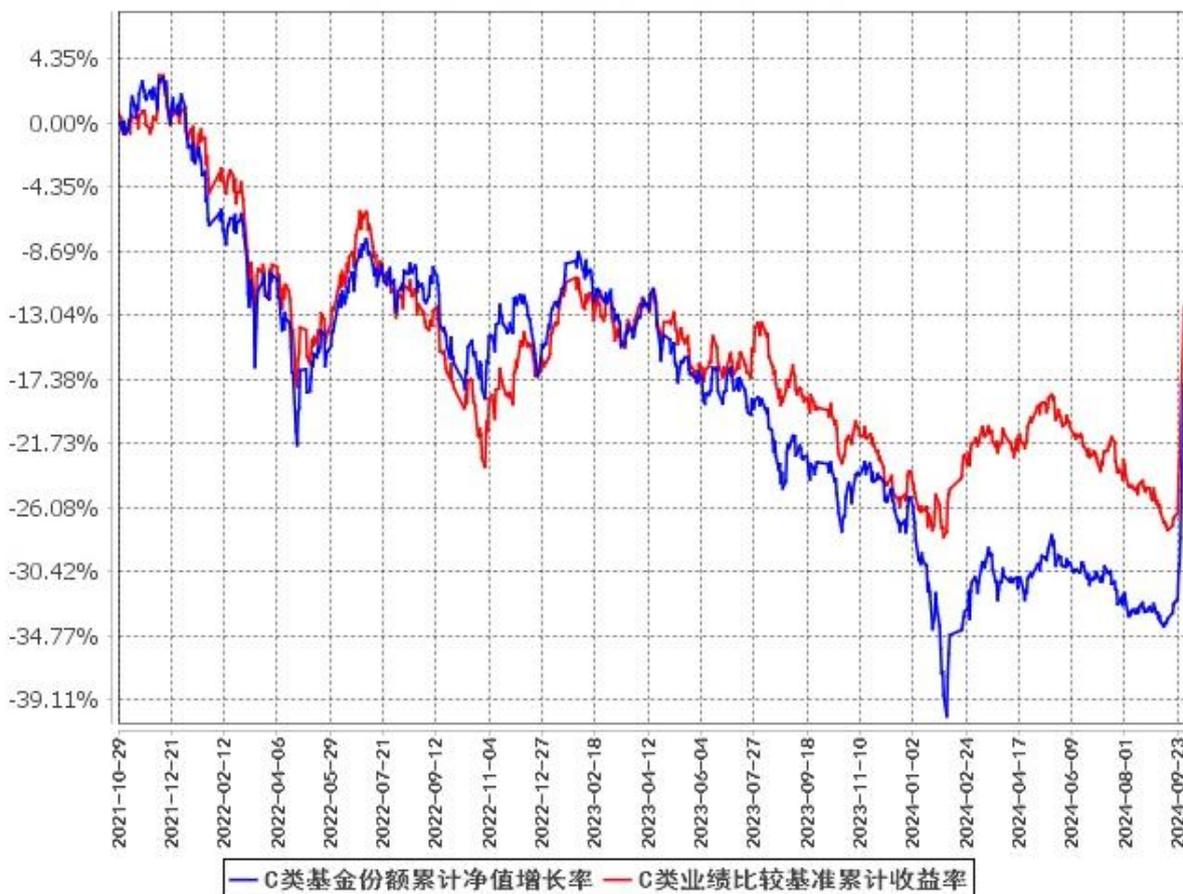
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	19.24%	1.49%	12.98%	1.23%	6.26%	0.26%
过去六个月	19.55%	1.16%	11.81%	0.98%	7.74%	0.18%
过去一年	6.95%	1.18%	8.51%	0.87%	-1.56%	0.31%
自基金合同生效起至今	-17.68%	1.01%	-12.47%	0.88%	-5.21%	0.13%

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类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10月29日至2024年9月30日)



C类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10月29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		
刘坚	本基金基金经理, FOF 投资部总监, 产品开发部总监, 总经理助理	2021年10月29日	-	12	刘坚先生, 中国国籍, 硕士。CFA/FRM。曾任恒生银行(中国)有限公司副总裁、宝盈基金管理有限公司产品经理、平安基金管理有限公司产品设计副总

					监等职。2020 年 6 月加入同泰基金管理有限公司，现任总经理助理、FOF 投资部总监、产品开发部总监、同泰优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理、同泰积极配置 3 个月持有期股票型基金中基金 (FOF) 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

报告期内，国内权益指数快速修复了年内的跌幅，而国内债券市场、尤其是信用债市场震荡加

剧。股票风格上，小盘成长跑赢大盘价值。上证指数上涨 12.44%，沪深 300 指数上涨 16.07%，创业板指数上涨 29.21%，科创 50 指数上涨 22.51%，北证 50 指数上涨 24.24%；港股表现依旧不俗，恒生指数上涨 19.27%；权益策略和行业方面，最直接受益于政策的房地产、证券板块领涨，商贸零售、社会服务、计算机、传媒等板块纷纷反弹，前期表现较好的红利板块相对涨幅较小；债券市场方面，受到理财产品赎回影响，公募债券基金表现震荡，但报告期内依然保持正收益，波动加大。商品方面，贵金属继续表现良好，伦敦金现货上涨超 13%。

报告期内，国内开启了新一轮综合性刺激政策，例如存量房贷下调、央行互换便利等一系列利好股市的政策出台，让市场在季末迎来股市的急涨和债市的快速调整。但整体而言，我国经济仍然在缓慢复苏过程中，正在经历复杂的内外部环境，复苏的节奏也需要更长时间的验证。不过，宏观政策目前的态度非常积极，我们对于股市的风险偏好也应该变得更加积极。外部环境方面，美联储终于开启降息的周期，这对海外资金回流是较大的利好，同时汇率的压力已经减轻，不再对我国货币政策形成过大的掣肘，但可能对出口造成一定扰动。此外，俄乌问题、巴以问题依然有升级趋势，美国大选正式迎来两党正面交锋的时刻。总体而言，复杂的内外部环境依然存在，但“以我为主”的态度不变。展望后市，更强有力的财政和货币政策出台已经是确定性事件，四季度的高层会议将是市场关注的核心，同时也要谨防地缘政治引发的黑天鹅事件对市场的冲击。

具体映射到投资市场：A 股市场政策的底部已经到来，但是巨大的波动之后可能引来分化，同时看好 A 股和港股的投资机会，配置上延续高股息及科技成长的哑铃策略，但逐步增加科技成长的配置比例；债券市场方面，短期震荡之后，我们仍然继续看好四季度到明年的债券市场整体表现；此外，大宗商品仍是关注的重点之一。

本产品将继续根据基金合同约定的投资目标，在基金合同约定的投资范围内，围绕场内基金进行多资产策略的构建，通过大类资产配置，力争实现超越业绩比较基准的收益。

本基金将一贯秉承“经得起托付，为信任奉献长期回报”的使命，努力实现长期资产的保值增值，力图成为基金份额持有人长期配置权益类资产的优先选择之一。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末同泰优选配置 3 个月持有混合 (FOF) A 的基金份额净值为 0.8309 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.35%；截至本报告期末同泰优选配置 3 个月持有混合 (FOF) C 的基金份额净值为 0.8232 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.24%；同期业绩比较基准收益率为 12.98%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	89,719,411.35	92.68
3	固定收益投资	4,636,000.99	4.79
	其中：债券	4,636,000.99	4.79
	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	192,081.84	0.20
8	其他资产	2,255,125.07	2.33
9	合计	96,802,619.25	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,636,000.99	4.82

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,636,000.99	4.82

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019740	24 国债 09	46,000	4,636,000.99	4.82

本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

本基金的投资范围不包括股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的投资范围不包括股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金的投资范围不包括国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金的投资范围不包括国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金的投资范围不包括国债期货。

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

本基金本报告期内未持有股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,245,056.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	100.00
6	其他应收款	9,968.20
7	其他	-
8	合计	2,255,125.07

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	159949	华安创业	交易型开	17,776,400.00	17,936,387.60	18.66	否

		板50ETF	放式				
2	159792	富国中证港股通互联网ETF	交易型开放式	20,380,600.00	14,979,741.00	15.59	否
3	588000	华夏上证科创板50成份ETF	交易型开放式	15,668,300.00	14,884,885.00	15.49	否
4	159967	华夏创成长ETF	交易型开放式	16,860,600.00	8,059,366.80	8.39	否
5	513200	易方达中证港股通医药卫生综合ETF	交易型开放式	9,706,600.00	7,697,333.80	8.01	否
6	513980	景顺长城中证港股通科技ETF	交易型开放式	13,150,100.00	7,272,005.30	7.57	否
7	159960	平安恒生中国企业ETF	交易型开放式	8,529,400.00	6,388,520.60	6.65	否
8	020155	长盛量化红利混合C	契约型开放式	1,477,301.45	4,310,765.63	4.49	否
9	515170	华夏中证细分食品饮料产业主题ETF	交易型开放式	5,846,100.00	3,957,809.70	4.12	否
10	008181	同泰慧利混合C	契约型开放式	2,087,950.29	2,150,797.59	2.24	是

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2024年7月1日至2024年9月30日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费(元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	-	-
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	-	-
当期交易所交易基金产生的交易费用(元)	177,690.42	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	同泰优选配置 3 个月持有混合 (FOF) A	同泰优选配置 3 个月持有混合 (FOF) C
报告期期初基金份额总额	413,855.76	123,065,538.21
报告期期间基金总申购份额	23,789.14	65,991.71
减：报告期期间基金总赎回份额	219,184.68	6,601,681.70
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	218,460.22	116,529,848.22

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。

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 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。

8.2 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。

§ 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、《同泰优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》；
- 2、《同泰优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议》；
- 3、报告期内同泰优选配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 公告的各项原稿。

10.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的住所或办公场所。

10.3 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