

---

财通资管臻享成长混合型证券投资基金

2023年第3季度报告

2023年09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:2023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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023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2023年07月01日起至09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	680,540,963.24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、金融衍生产品投资策略。
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	550,596,525.60份	129,944,437.64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(2023年07月01日 - 2023年09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	-6,104,174.78	-1,550,956.66
2.本期利润	-22,004,112.88	-5,295,626.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0387	-0.0395
4.期末基金资产净值	494,589,145.32	116,454,808.44
5.期末基金份额净值	0.8983	0.8962

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	-4.18%	0.74%	-2.95%	0.68%	-1.23%	0.06%
过去六个月	-9.09%	0.64%	-6.46%	0.65%	-2.63%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-10.17%	0.59%	-7.68%	0.63%	-2.49%	-0.04%

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	-4.27%	0.74%	-2.95%	0.68%	-1.32%	0.06%
过去六个月	-9.27%	0.64%	-6.46%	0.65%	-2.81%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-10.38%	0.59%	-7.68%	0.63%	-2.70%	-0.04%

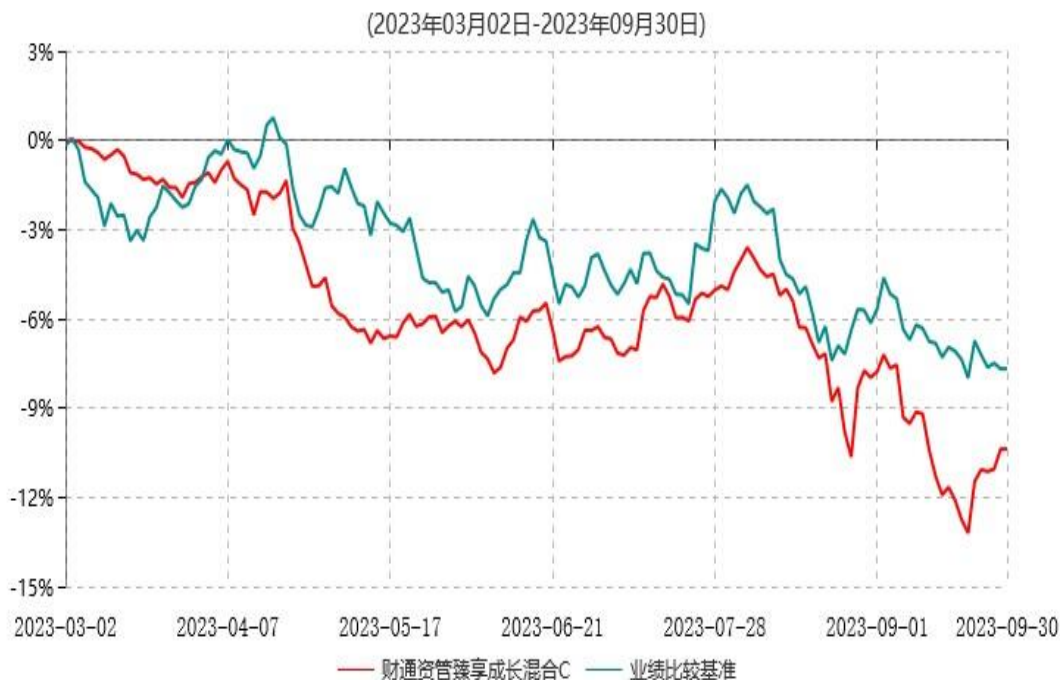
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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-2023年09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



注：1、本基金合同于 2023 年 03 月 02 日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一年。  
2、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	本基金基金经理和财通资管均衡臻选混合型证券投资基金基金经理。	2023-03-02	-	12	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	2	1,114,323,740.26	2022-11-15
	私募资产管理计划	8	469,366,970.20	2019-04-18
	其他组合	-	-	-
	合计	10	1,583,690,710.46	-

#### 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

2023年三季度，市场整体维持震荡下探。A股本季度主要指数悉数下跌，创业板指、深证成指分别下跌9.53%、8.32%，万得全A、沪深300分别下跌4.33%、3.98%。权益资产方面，TMT延续弱势调整，传统经济在三季度受到了明显的支持,金融和地产板块表现亮眼，尤其是非银金融三季度涨幅领先，其次红利策略环境和供给侧因素下煤炭、石油石化、钢铁板块涨幅仅次于非银金融。

基金报告期内需完成建仓，期间管理人采取了相对保守的投资策略，结合市场环境逐步提升组合仓位。加仓延续了中观景气度投资方法，结合自下而上的研究方式，重点布局在具备产业技术突破和景气度改善的细分行业，板块布局相对均衡，以中游高端制造为主，涉及行业新技术和国产替代，涉及行业新技术和国产替代，细分领域在工业母机和半导体制造、机器人、智能驾驶、以及光伏电池片新技术。

展望四季度，当前中国经济正处于转型换挡期，不能再依靠原来的三驾马车拉动，我们必须要做到换挡，从低附加值简单商品切入到高附加值的商品，经济才能进入更健康和可持续的发展。地产政策的出台认为可能已经错过了最佳刺激的时间，但属于可以短期触动交易的友善政策，真正的改变需要看到供需关系的变化。所以，对于顺周期板块投资机会以择时为主。其次，只要市场不再继续单边下跌，不会转变当前的持仓结构，还是以均衡配置为主。

#### 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0.8983元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.18%，同期业绩比较基准收益率为-2.95%；截至报告期末财通资管臻享成长混合C基金份额净值为0.8962元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.27%，同期业绩比较基准收益率为-2.95%。

#### 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	397,101,740.85	64.65
	其中：股票	397,101,740.85	64.65
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	-148,054.35	-0.02

	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	65,075,304.47	10.60
8	其他资产	152,175,490.81	24.78
9	合计	614,204,481.78	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	321,579,439.65	52.63
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	9,117,744.00	1.49
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	34,476,213.20	5.64
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	19,847,160.00	3.25
R	文化、体育和娱乐业	12,081,184.00	1.98
S	综合	-	-
	合计	397,101,740.85	64.99



## 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	428,889	54,305,925.18	8.89
2	002436	兴森科技	4,290,100	52,382,121.00	8.57
3	002463	沪电股份	1,312,850	29,552,253.50	4.84
4	002410	广联达	1,065,580	24,891,948.80	4.07
5	002050	三花智控	835,700	24,820,290.00	4.06
6	688012	中微公司	143,044	21,535,274.20	3.52
7	002044	美年健康	2,918,700	19,847,160.00	3.25
8	603517	绝味食品	525,300	19,740,774.00	3.23
9	300161	华中数控	442,400	19,332,880.00	3.16
10	603688	石英股份	175,900	18,763,253.00	3.07

## 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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，绝味食品股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所、中国证券监督管理委员会湖南监管局的处罚。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资有严格的投资决策流程控制，本基金对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上，本基金严格执行公司个券审核流程。在对该证券的持有过程中，研究员密切关注证券发行主体动向，在上述处罚发生时及时分析其对该投资决策的影响。经过分析认为此事件对该证券发行主体的财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，因此不影响对该证券基本面和投资价值的判断。

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	205,474.18
2	应收证券清算款	151,955,071.52

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,945.11
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	152,175,490.81

#### 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

	财通资管臻享成长混合 A	财通资管臻享成长混合 C
报告期期初基金份额总额	593,253,856.60	140,039,513.53
报告期期间基金总申购份额	641,389.03	581,580.87
减：报告期期间基金总赎回份额	43,298,720.03	10,676,656.76
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	550,596,525.60	129,944,437.64

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，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

本报告期本基金管理人无运用固有资金申购、赎回本基金的情况。

## §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、自2023年7月31日起，本基金的管理费年费率由1.50%调低至1.20%，托管费年费率由0.25%调低至0.20%。

2、2023年8月4日，胡珍珍同志离任本基金管理人财务负责人，由钱慧同志代任财务负责人。

## §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

2023年10月25日