

财通沪深300指数增强型证券投资基金2022年第4季度报告

(原财通量化价值优选混合转型)

2022年12月31日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2023年01月21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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年1月20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2022年10月1日起至12月31日止。

根据《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》，经与基金托管人协商一致，基金管理人已就上述审议本基金《基金合同》修改相关事宜报中国证监会进行变更注册。自2022年12月21日起，本基金的基金名称由“财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金”变更为“财通沪深300指数增强型证券投资基金”，《财通沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》、《财通沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》生效。

## §2 基金产品概况

### 转型后

基金简称	财通沪深300指数增强
场内简称	-
基金主代码	005850
交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金转型合同生效日	2022年12月21日
报告期末基金份额总额	120,071,391.10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被动投资基础上，结合增强型的主动投资，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	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制本

	<p>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8%；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。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。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。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。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。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。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。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>沪深300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。 本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，跟踪沪深300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>

基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

### 转型前

基金简称	财通量化价值优选混合
场内简称	-
基金主代码	005850
交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年01月30日
报告期末基金份额总额	119,111,800.66份
投资目标	利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。本基金量化投资模型主要包括运用多因子alpha模型进行股票超额回报预测，通过风险估测模型有效控制预期风险，借助交易成本模型控制交易成本以保护投资业绩，同时对投资组合的优化和调整；本基金固定收益类资产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；本基金将在严格控制风险的前提下进行权证投资；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；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。</p>

业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高收益的基金产品。
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标(转型后)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年12月21日 - 2022年12月31日）
1.本期已实现收益	-3,662,937.45
2.本期利润	511,857.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0043
4.期末基金资产净值	172,919,350.63
5.期末基金份额净值	1.4401

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)根据本基金基金份额持有人大会表决结果，本基金自2022年12月21日起转型为财通沪深300指数增强型证券投资基金；

(4)本报告期自2022年12月21日至2022年12月31日。

#### 3.1 主要财务指标(转型前)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年10月01日 - 2022年12月20日）
1.本期已实现收益	-5,974,566.90
2.本期利润	443,795.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0040
4.期末基金资产净值	171,028,759.46

5.期末基金份额净值	1.4359
------------	--------

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)根据本基金基金份额持有人大会表决结果，本基金自2022年12月21日起转型为财通沪深300指数增强型证券投资基金；

(4)本报告期自2022年10月01日至2022年12月20日。

### 3.2 基金净值表现(转型后)

#### 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

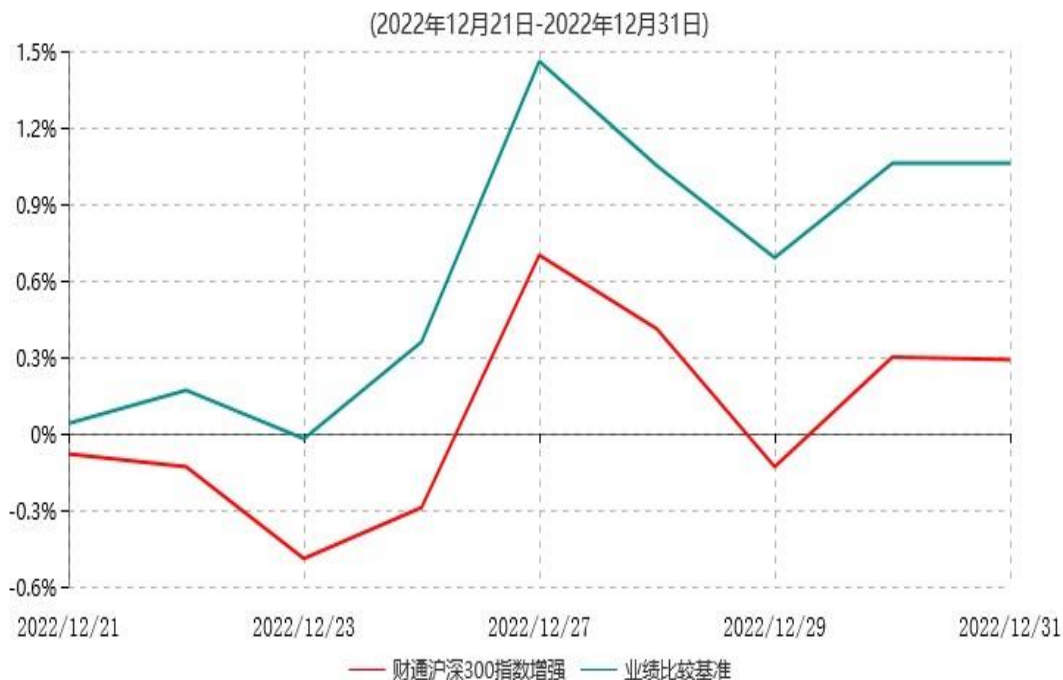
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.29%	0.46%	1.06%	0.46%	-0.77%	0.00%

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)本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

#### 3.2.2 自基金转型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

财通沪深300指数增强型证券投资基金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)根据本基金基金份额持有人大会表决结果，本基金自2022年12月21日起转型为财通沪深300指数增强型证券投资基金，基金转型日至披露时点不满一年；

(2)本基金建仓期是合同生效日起6个月，截止本报告期末，本基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

### 3.2 基金净值表现(转型前)

#### 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

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 (2022年10月01日-2022年12月20日)	0.83%	1.17%	0.61%	1.04%	0.22%	0.13%
过去六个月 (2022年07月01日-2022年12月20日)	-8.99%	1.01%	-10.75%	0.85%	1.76%	0.16%
过去一年(2	-14.58%	1.18%	-16.38%	0.98%	1.80%	0.20%

022年01月01日-2022年12月20日)						
过去三年(2020年01月01日-2022年12月20日)	23.75%	1.24%	-1.10%	0.98%	24.85%	0.26%
自基金合同生效起至今(2019年01月30日-2022年12月20日)	43.59%	1.19%	20.72%	0.97%	22.87%	0.22%

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：沪深300指数收益率×75%+中债综合全价指数收益率×25%。

### 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

财通量化价值优选混合累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年01月30日-2022年12月20日)



注：(1)本基金合同生效日为2019年01月30日，转型日期为2022年12月21日；

(2)本基金建仓期是合同生效日起6个月，截至本报告期末，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	量化投资部总经理助理（主持工作）、本基金的基金经理	2019-07-16	-	11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，现任量化投资部总经理助理（主持工作）、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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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制度》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

本投资组合为开放式基金。本报告期内，本投资组合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

报告期内，本基金组合采用类行业中性配置，控制行业暴露在较低范围之内，同时控制组合相对市场主流风格如大小盘、价值、成长等的暴露，采用量化模型在行业内优选个股，分散持仓，力争追求相对基准的长期稳定的超额收益。

上季度末，我们认为彼时是A股处于性价比相对较高的位置，从风格上我们认为高弹性、小市值板块可能会有更高的胜率和性价比。从事后看，四季度沪深300上涨1.75%，国证2000上涨4.25%，基本符合预期。

展望后市，管控放开促使经济复苏概率进一步提高，从而可能影响企业盈利能力逐步回升。虽然可能存在疫情反复的风险，让未来存在较大不确定性，从而一定程度上影响市场风险偏好，进而压制估值。但是考虑到目前估值处于历史较低水平。因此整体而言，我们认为目前仍可保持乐观。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，财通沪深300指数增强基金份额净值为1.4401元，自2022年12月21日至2022年12月31日，基金份额净值增长率为0.29%，同期业绩比较基准收益率为1.06%；截至2022年12月20日，财通量化价值优选混合基金份额净值为1.4359元，自2022年12月21日至2022年12月31日，基金份额净值增长率为0.83%，同期业绩比较基准收益率为0.61%。

#### 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(转型后)

#### 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	163,862,953.36	91.96
	其中：股票	163,862,953.36	91.96
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	13,208,586.89	7.41
8	其他资产	1,112,424.78	0.62
9	合计	178,183,965.03	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（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	2,770,742.00	1.60
B	采矿业	9,214,508.00	5.33

C	制造业	65,443,849.46	37.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,259,010.00	3.62
E	建筑业	3,598,010.20	2.08
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,335,028.00	1.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,345,835.51	1.93
J	金融业	25,966,738.47	15.02
K	房地产业	4,086,073.00	2.36
L	租赁和商务服务业	4,317,581.56	2.50
M	科学研究和技术服务业	5,670.00	0.00
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	266,936.38	0.15
R	文化、体育和娱乐业	231,154.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	128,841,136.58	74.51

### 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	586,755.00	0.34
C	制造业	22,444,578.16	12.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,060,753.29	0.61
E	建筑业	1,082,985.00	0.63
F	批发和零售业	1,074,833.00	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	551,004.00	0.32

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,945,969.10	1.13
J	金融业	1,969,997.39	1.14
K	房地产业	1,412,114.00	0.82
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,826,041.30	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	17,100.42	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	19,584.60	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,030,101.52	0.60
S	综合	-	-
	合计	35,021,816.78	20.25

### 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	600036	招商银行	247,700	9,229,302.00	5.34
2	000333	美的集团	105,950	5,488,210.00	3.17
3	000858	五粮液	25,110	4,537,125.90	2.62
4	600030	中信证券	217,507	4,330,564.37	2.50
5	601899	紫金矿业	425,399	4,253,990.00	2.46
6	000651	格力电器	128,457	4,151,730.24	2.40
7	300750	宁德时代	9,600	3,776,832.00	2.18
8	600900	长江电力	179,300	3,765,300.00	2.18
9	300059	东方财富	183,417	3,558,289.80	2.06
10	601888	中国中免	16,116	3,481,539.48	2.01

### 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	002548	金新农	364,548	2,099,796.48	1.21
2	603444	吉比特	4,400	1,376,496.00	0.80
3	300012	华测检测	57,400	1,280,020.00	0.74
4	600885	宏发股份	38,300	1,279,603.00	0.74
5	603605	珀莱雅	7,280	1,219,254.40	0.71

### 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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

#### 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	61,696.81
2	应收证券清算款	931,687.80
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	119,040.17
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,112,424.78

### 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	002548	金新农	2,099,796.48	1.21	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。

## §5 投资组合报告（转型前）

### 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	156,783,335.42	91.35
	其中：股票	156,783,335.42	91.35
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	14,748,448.73	8.59
8	其他资产	102,599.06	0.06
9	合计	171,634,383.21	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	9,069,381.10	5.30
C	制造业	81,580,995.12	47.70
D	电力、热力、燃气及水生	6,983,940.73	4.08



	产和供应业		
E	建筑业	4,700,268.60	2.75
F	批发和零售业	2,992,374.00	1.75
G	交通运输、仓储和邮政业	2,028,915.00	1.19
H	住宿和餐饮业	1,219,328.00	0.71
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,002,622.59	2.93
J	金融业	31,704,197.70	18.54
K	房地产业	3,077,952.00	1.80
L	租赁和商务服务业	2,824,378.04	1.65
M	科学研究和技术服务业	3,783,265.22	2.21
N	水利、环境和公共设施管理业	164,789.88	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	216,370.36	0.13
R	文化、体育和娱乐业	1,434,557.08	0.84
S	综合	-	-
	合计	156,783,335.42	91.67

### 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机制投资的港股。

### 5.3 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	600036	招商银行	194,200	6,936,824.00	4.06
2	300750	宁德时代	13,100	5,364,712.00	3.14
3	601899	紫金矿业	445,999	4,415,390.10	2.58
4	000333	美的集团	82,150	4,236,475.50	2.48
5	600030	中信证券	209,207	4,123,469.97	2.41
6	000651	格力电器	126,957	4,100,711.10	2.40
7	600519	贵州茅台	2,125	3,644,375.00	2.13
8	601668	中国建筑	585,140	3,212,418.60	1.88

9	600900	长江电力	141,400	2,881,732.00	1.68
10	300012	华测检测	117,300	2,544,237.00	1.49

#### 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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

##### 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	61,906.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	40,692.81
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	102,599.06

### 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，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(转型后)

单位：份

基金合同生效日(2022年12月21日)基金份额总额	119,111,800.66
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	960,373.55
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	783.11
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变	-

动份额（份额减少以“-”填列）	
报告期期末基金份额总额	120,071,391.10

注：(1)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；  
 (2)根据本基金基金份额持有人大会表决结果，本基金自2022年12月21日起转型为财通沪深300指数增强型证券投资基金。

### §6 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

报告期期初基金份额总额	113,452,772.80
报告期期间基金总申购份额	23,963,782.90
减：报告期期间基金总赎回份额	18,304,755.04
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	119,111,800.66

注：(1)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；  
 (2)根据本基金基金份额持有人大会表决结果，本基金自2022年12月21日起转型为财通沪深300指数增强型证券投资基金。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人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

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型前)

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人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

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

投资者类别						况	
	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	2022-10-01至2022-12-31	65,126,999.06	0.00	0.00	65,126,999.06	54.24%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金转型方案说明书》，经与基金托管人协商一致，基金管理人已就上述审议本基金《基金合同》修改相关事宜报中国证监会进行变更注册。自2022年12月21日起，本基金的基金名称由“财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金”变更为“财通沪深300指数增强型证券投资基金”，《财通沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》、《财通沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》生效。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、财通沪深300指数增强型证券投资基金基金合同；
- 3、财通沪深300指数增强型证券投资基金托管协议；
- 4、财通沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 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楼。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：<http://www.ctfund.com>

财通基金管理有限公司  
二〇二三年一月二十一日