

财通资管新添益6个月持有期混合型发起式证券投资基金

2021年第2季度报告

2021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:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2021年07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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月15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2021年04月01日起至06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	财通资管新添益6个月持有期混合
基金主代码	011084
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月28日
报告期末基金份额总额	10,004,099.19份
投资目标	在严格控制风险的基础上，把握市场机会，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的投研能力，采取自上而下的方法对基金的大类资产进行动态配置，综合久期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选，力争在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定超额收益。另外，本基金可投资于股票等权益类资产，基金管理人将选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资，强化基金的获利能力，提高预期收益水平，以期达到收益增强的效果。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×75%+沪深300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	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	财通资管新添益6个月持有期混合A	财通资管新添益6个月持有期混合C
下属分级基金的交易代码	011084	011085
报告期末下属分级基金的份额总额	10,004,039.11份	60.08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(2021年04月01日 - 2021年06月30日)	
	财通资管新添益6个月持有期混合A	财通资管新添益6个月持有期混合C
1. 本期已实现收益	-68,371.87	-0.31
2. 本期利润	22,320.47	0.25
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0022	0.0042
4. 期末基金资产净值	9,965,908.37	60.11
5. 期末基金份额净值	0.9962	1.0005

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、本期已实现收益指本期基金利息收入、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。

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

财通资管新添益6个月持有期混合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	0.22%	0.17%	1.25%	0.25%	-1.03%	-0.08%

月						
过去六个月	-0.38%	0.12%	0.74%	0.33%	-1.12%	-0.21%
自基金合同生效起至今	-0.38%	0.12%	1.72%	0.33%	-2.10%	-0.21%

财通资管新添益6个月持有期混合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	0.42%	0.17%	1.25%	0.25%	-0.83%	-0.08%
过去六个月	0.05%	0.12%	0.74%	0.33%	-0.69%	-0.21%
自基金合同生效起至今	0.05%	0.12%	1.72%	0.33%	-1.67%	-0.21%

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

财通资管新添益6个月持有期混合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



财通资管新添益6个月持有期混合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 2020 年 12 月 28 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。
 3、自基金合同生效至报告期末，财通资管新添益 6 个月持有期混合 A 基金份额净值增长率为-0.38%，同期业绩比较基准收益率为 1.72%；财通资管新添益 6 个月持有期混合 C 基金份额净值增长率为 0.05%，同期业绩比较基准收益率为 1.72%。

§ 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		
顾宇笛	本基金基金经理、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金、财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金和财通资管鸿盛12个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2020-12-28	-	7	华东师范大学经济学硕士。2014年6月至2014年12月担任财通证券股份有限公司资产管理部债券研究员；2015年1月至2017年8月担任财通证券资产管理有限公司固定收益部债券研究员，2017年8月起担任基金经理岗位。
辛晨晨	本基金基金经理、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金和财通资管智选核心回报6个月持有期混合型发起式证券投资基金基金经理。	2020-12-28	-	8	清华大学硕士，2012年7月加入中信建投证券任产品及金融创新部高级经理，2015年6月加入上海证券交易所任基金与衍生品部襄理，2016年6月加入嘉实资本管理有限公司任阳光对冲平台高级投资经理，2017年6月加入兴证证券资产管理有限公司创新投资部资深投资经理，2020年8月加入财通证券资产管理有限公司。
邹舟	本基金基金经理、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金	2021-02-04	-	5	美国本特利大学会计学硕士、工商管理学硕士。2016年4月加入财通证券资产管理有限公司，历任固

	和财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金基金经理。				定收益部交易员，固收公募投资部基金经理助理。
--	-------------------------	--	--	--	------------------------

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行业协会《证券从业人员资格管理办法》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

期末本基金基金经理无同时管理私募资产管理计划的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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《财通资管新添益6个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》、《财通资管新添益6个月持有期混合型发起式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

二季度权益市场方面，A股走势呈现出结构性分化的行情，科创50和创业板指数涨幅超过25%，以上证50为代表的大盘股走势较弱，市场风格从过去两年的大市值龙头公司开始向盈利能力强劲的中小市值扩散。二季度由于海外一些国家疫情反复，市场显示出对全球货币宽松政策逐步退出之后的经济下探的担忧，高估值板块走势开始出现分化，市场开始寻求有盈利增长确定性支撑的优质企业。在具体行业上，二季度市场出现了三个方面的机会，一是全球新冠疫苗加速获批及接种下的生物医药及医疗服务等板

块；二是新能源汽车销售数据超预期带来的新能源汽车板块整体投资机会；三是由供需缺口带来的半导体领域的投资机会。回顾权益部分二季度表现，为了平衡组合的弹性和波动，我们在行业上持仓较为均衡，对于优质板块的参与不够，导致组合二季度表现相对市场不尽如人意。展望下半年，我们保持对于宏观经济走弱、通胀等问题的担忧，以回撤控制为投资管理中的首要目标，积极把握顺周期板块以及盈利持续超预期的景气行业的投资机会，力争为持有人创造长期稳定的投资回报。在固定收益部分，二季度组合仅参与可转债及逆回购等投资，由于规模较小暂未参与其他债券类资产投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管新添益6个月持有期混合A基金份额净值为0.9962元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.22%，同期业绩比较基准收益率为1.25%；截至报告期末财通资管新添益6个月持有期混合C基金份额净值为1.0005元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.42%，同期业绩比较基准收益率为1.25%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内无需要说明的相关情况。

§ 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	2,544,964.20	25.14
	其中：股票	2,544,964.20	25.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	85,379.00	0.84
	其中：债券	85,379.00	0.84
	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	3,900,000.00	38.52
	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	3,543,544.50	35.00
8	其他资产	50,185.31	0.50

9	合计	10,124,073.01	100.00
---	----	---------------	--------

注：由于四舍五入的原因，金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	235,446.00	2.36
C	制造业	2,050,684.20	20.58
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	-	-
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	78,304.00	0.79
J	金融业	95,500.00	0.96
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	65,700.00	0.66
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	19,330.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,544,964.20	25.54

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值比例分项之和与合计可能有尾差。

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	300655	晶瑞股份	2,600	94,874.00	0.95
2	002138	顺络电子	2,400	93,048.00	0.93
3	002484	江海股份	4,700	72,756.00	0.73
4	300390	天华超净	1,500	72,045.00	0.72
5	002876	三利谱	1,100	71,170.00	0.71
6	000988	华工科技	3,000	70,560.00	0.71
7	002384	东山精密	3,300	68,772.00	0.69
8	601898	中煤能源	9,600	68,640.00	0.69
9	300408	三环集团	1,600	67,872.00	0.68
10	601799	星宇股份	300	67,716.00	0.68

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金投资范围未包含全国中小企业股份转让系统挂牌的股票。

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	-	-
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）	85,379.00	0.86
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	85,379.00	0.86

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	128129	青农转债	500	53,432.00	0.54
2	127020	中金转债	200	21,939.40	0.22
3	127018	本钢转债	100	10,007.60	0.10

注：本基金本报告期末仅持有上述三只债券。

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

本基金按照风险管理的原则，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，获取超额收益。

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中三利谱（证券代码：002876）的发行主体在本报告编制日前一年内受到公开处罚。报告期内本基金投资的前十名证券的其他发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日一年以内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券之一三利谱（证券代码：002876）的发行主体深圳市三利谱光电科技股份有限公司于2020年08月21日收到深圳证券交易所监管函（中小板监管函【2020】第106号），被出具监管关注处分决定。

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	1,372.07
2	应收证券清算款	47,731.97
3	应收股利	-
4	应收利息	1,081.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	50,185.31

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128129	青农转债	53,432.00	0.54
2	127020	中金转债	21,939.40	0.22
3	127018	本钢转债	10,007.60	0.10

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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	财通资管新添益6个月 持有期混合A	财通资管新添益6个月 持有期混合C
报告期期初基金份额总额	10,004,039.11	60.08
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	10,004,039.11	60.08

§ 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

单位：份

	财通资管新添益6个月 持有期混合A	财通资管新添益6个月 持有期混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	99.96	-

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额 总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额 总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额承诺持有 期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	99.96%	10,000,000.00	99.96%	自基金合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	99.96%	10,000,000.00	99.96%	自基金合同生效之日起不少于3年

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	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	20210401-20210630	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	99.96%
产品特有风险							
本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性风险，从而影响基金的投资运作和收益水平。管理人将在基金运作中加强流动性管理，保持合适的流动性水平，对申购赎回进行合理的应对，防范流动性风险，保障持有人利益。							

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、财通资管新添益6个月持有期混合型发起式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、财通资管新添益6个月持有期混合型发起式证券投资基金托管协议
- 4、财通资管新添益6个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同
- 5、财通资管新添益6个月持有期混合型发起式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

10.2 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四宜路四宜大院B幢办公楼

10.3 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：95336

公司网址：www.ctzg.com

财通证券资产管理有限公司

2021年07月21日