

同泰积极配置 3 个月持有期股票型基金中
基金 (FOF)
2023 年第 3 季度报告

2023 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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 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 7 月 1 日起至 2023 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	同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF)
基金主代码	016316
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 3 日
报告期末基金份额总额	344,462,583.10 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×80%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合全价(总值)指数收益率×10%

风险收益特征	本基金为股票型基金中基金，预期收益和风险水平高于混合型基金、混合型基金中基金、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	平安银行股份有限公司	
下属分类基金的基金简称	同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) A	同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) C
下属分类基金的交易代码	016316	016317
报告期末下属分类基金的份额总额	214,241,519.11 份	130,221,063.99 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 7 月 1 日—2023 年 9 月 30 日)	
	同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) A	同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) C
1. 本期已实现收益	-3,457,921.18	-2,355,065.02
2. 本期利润	-5,708,633.32	-3,635,885.05
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0294	-0.0276
4. 期末基金资产净值	217,656,901.14	131,808,213.98
5. 期末基金份额净值	1.0159	1.0122

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

同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) A

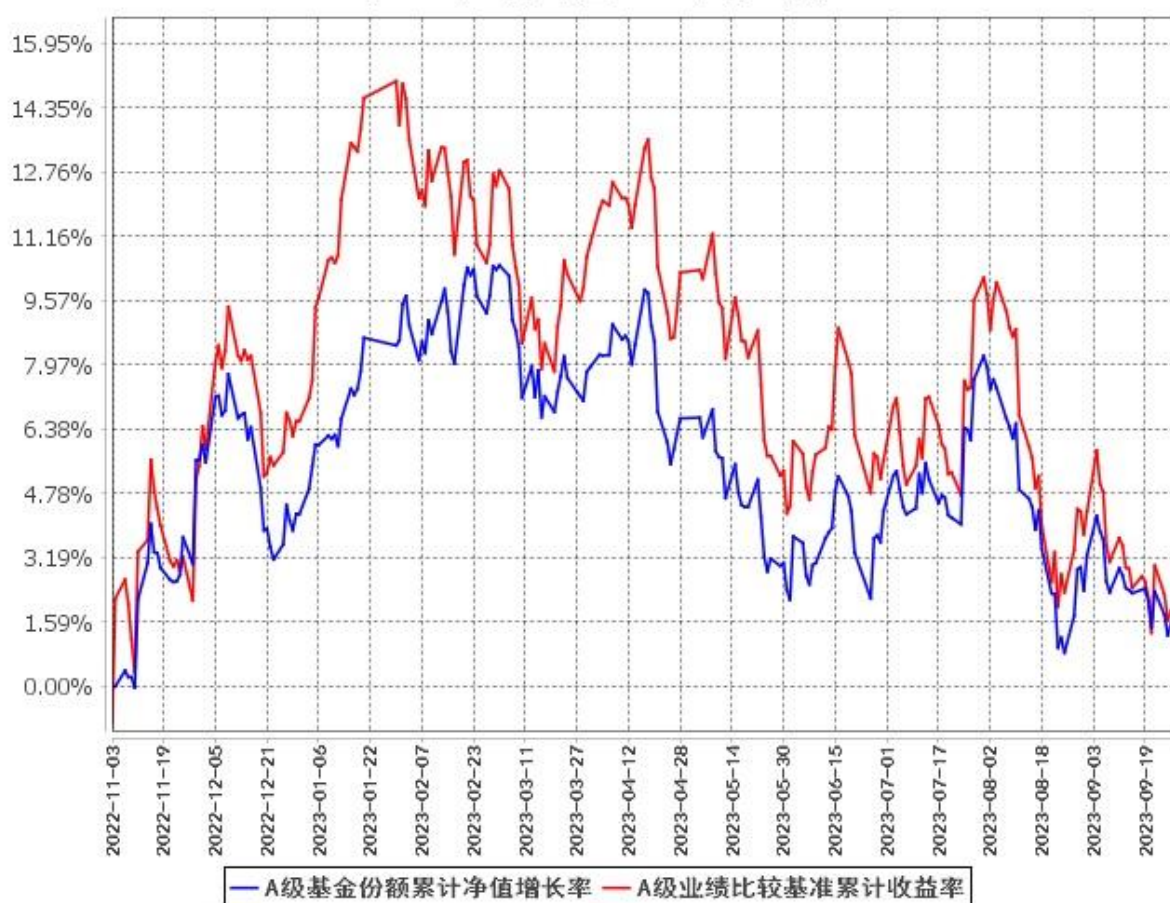
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.65%	0.64%	-3.66%	0.83%	1.01%	-0.19%
过去六个月	-5.86%	0.64%	-8.29%	0.79%	2.43%	-0.15%
自基金合同生效起至今	1.59%	0.64%	1.76%	0.86%	-0.17%	-0.22%

同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) C

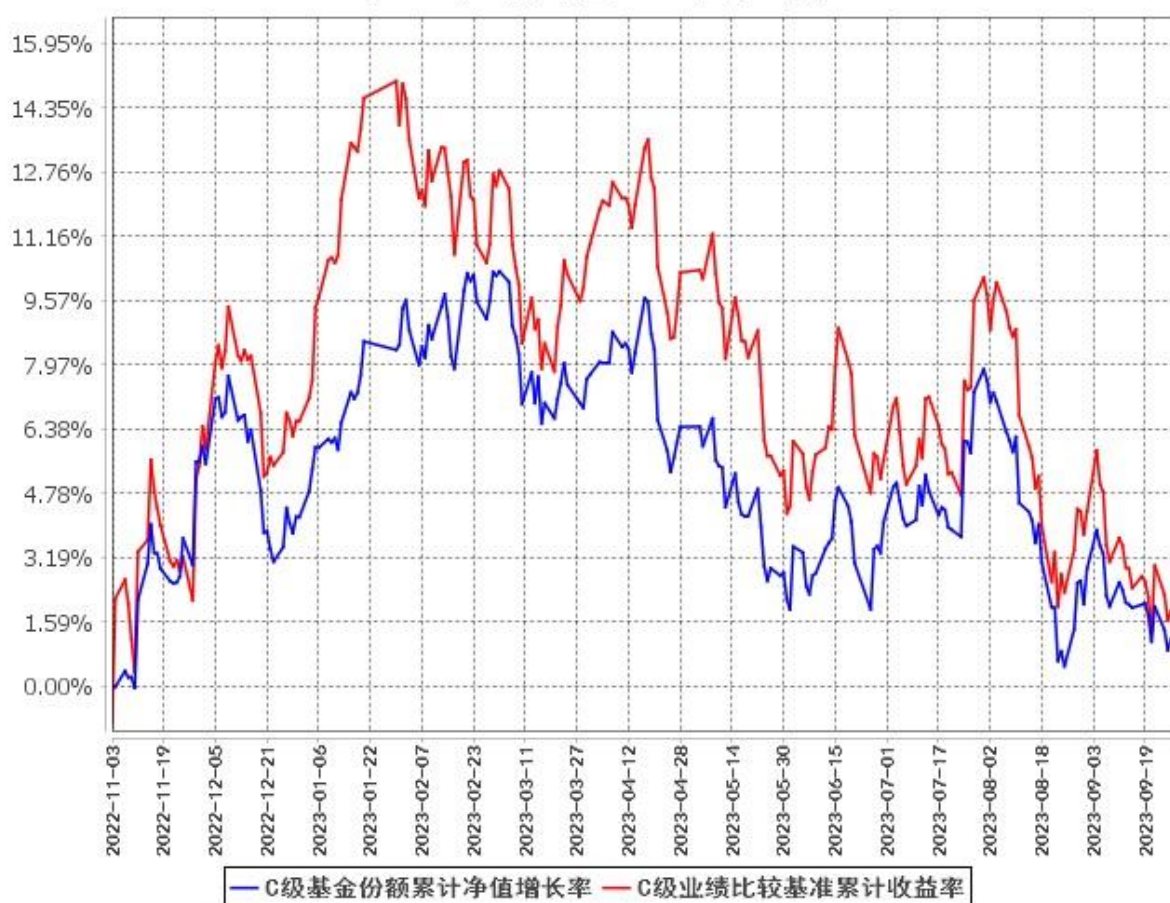
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.75%	0.64%	-3.66%	0.83%	0.91%	-0.19%
过去六个月	-6.04%	0.64%	-8.29%	0.79%	2.25%	-0.15%
自基金合同生效起至今	1.22%	0.64%	1.76%	0.86%	-0.54%	-0.22%

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级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
(2022年11月3日至2023年9月30日)



C级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
(2022年11月3日至2023年9月30日)



注：(1) 本基金合同于 2022 年 11 月 3 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

(2) 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	2022 年 11 月 3 日	-	11	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 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，国内主要权益指数延续了今年以来的弱势表现。上证指数下跌 2.86%，沪深 300 指数

下跌 3.98%，创业板指数下跌 9.53%，科创 50 指数下跌 11.67%；恒生指数下跌 5.85%；中证偏股型基金指数下跌 6.53%。报告期内，主动偏股型基金整体表现仍不佳；从风格指数来看，价值风格跑赢成长风格。

进入三季度，海内外经济节奏与二季度基本一致：国内经济复苏力度略显不足、投资者信心不足，而美国经济超预期强劲，使市场对美债收益率维持高位的预期延续到明年下半年。资本市场方面，国内逆周期和稳增长政策频出，但效果有待观察；强势美元对汇率市场持续带来负面情绪，陆股通资金大额进出也频繁造成扰动，对国内的风险资产定价造成压制。相较于股市，在国内流动性充沛环境以及理财配置资产荒的大背景下，债市今年以来表现相对较优。

“百年未有之大变局”在今年显得格外贴切，影响投资决策的内外部因素急剧增加，超过年初的预期。基金重仓股指数的表现不佳也印证了今年主动权益基金的投资难度较大。权益指数型产品表现相对更优，也是我们今年重点研究和策略升级的主要方向。但今年以来没有为投资者实现盈利，再多的解读也显得十分苍白，唯有继续努力寻找投资机会，尽快提升产品业绩。

展望四季度，虽然内外部环境都有所担忧，但我更愿意保持乐观：底气来自于中国拥有全球最齐备的制造业产业链和第二大经济体的身份；惊喜或许会来自于硬科技领域的突破和自立；胜率则来自于当前权益市场所处位置，加之国内低利率环境大概率仍将延续。

本产品根据基金合同约定的投资目标，在均衡配置的基础上，围绕产业趋势和基本面适当配置了部分看好的行业板块，对持仓基金进行持续动态优化。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积极配置 3 个月持有股票 (FOF) A 的基金份额净值为 1.0159 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.65%；截至本报告期末同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) C 的基金份额净值为 1.0122 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.75%；同期业绩比较基准收益率为-3.66%。

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	325,569,046.01	92.90
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	2,100,002.10	0.60
	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	14,755,819.02	4.21
8	其他资产	8,018,678.03	2.29
9	合计	350,443,545.16	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

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。

5.3.2 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

无。

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受到调查以及处罚的情况的说明

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	6,451,707.38
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—

5	应收申购款	1,566,970.65
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,018,678.03

注：本基金持有的存出保证金包含存放在证券经纪商资金账户的证券交易结算资金。

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	006624	中泰玉衡价值优选混合 A	契约型开放式	22,742,888.32	49,502,170.72	14.17	否
2	688888	浙商聚潮产业成长混合 A	契约型开放式	29,044,114.35	47,922,788.68	13.71	否
3	001907	国投瑞银境煊混合 A	契约型开放式	15,112,036.09	43,963,935.39	12.58	否
4	012002	中泰星宇价值成长混合 C	契约型开放式	50,265,560.78	42,162,752.38	12.06	否
5	161222	国投瑞银瑞利混合 (LOF) A	契约型开放式	13,431,765.47	30,946,787.64	8.86	否
6	011128	华安精致生活混合 A	契约型开放式	24,900,555.14	29,659,051.23	8.49	否
7	004355	嘉实丰和灵活配置混合 A	契约型开放式	12,761,062.76	25,550,199.86	7.31	否
8	014967	建信潜力新蓝筹股票 C	契约型开放式	4,554,623.17	13,814,172.07	3.95	否

9	001887	中欧价值智选混合 E	契约型开放式	2,729,678.91	11,315,883.92	3.24	否
10	009275	融通医疗保健行业混合 C	契约型开放式	4,572,341.80	8,417,681.25	2.41	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023 年 7 月 1 日至 2023 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）	25,571.02	—
当期交易基金产生的赎回费（元）	186,369.97	—
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）	1,247.34	—
当前交易基金产生的转换费（元）	399,010.98	—

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	同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) A	同泰积极配置 3 个月持有股票 (FOF) C
报告期期初基金份额总额	174,403,242.93	140,532,915.33
报告期期间基金总申购份额	48,599,741.57	4,024,574.27
减：报告期期间基金总赎回份额	8,761,465.39	14,336,425.61
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	214,241,519.11	130,221,063.99
-------------	----------------	----------------

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

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	2023 年 7 月 1 日-2023 年 8 月 9 日	65,212,251.38	-	4,000,000.00	61,212,251.38	17.77%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动等风险。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

因本基金管理人第一届董事会任期届满，经股东会决议，选举马俊生先生、王雪梅女士、刘韞芬女士、韩世君先生、方仲友先生、徐文学先生担任第二届董事会董事。同时，原董事长刘文灿先生因任期届满离任，由总经理马俊生先生代为履行职务。

上述事项已于 2023 年 8 月 12 日在中国证监会指定的媒介上公告。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、《同泰积极配置 3 个月持有期股票型基金中基金 (FOF) 基金合同》；
- 2、《同泰积极配置 3 个月持有期股票型基金中基金 (FOF) 托管协议》；
- 3、报告期内同泰积极配置 3 个月持有期股票型基金中基金 (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免费查阅。

同泰基金管理有限公司

2023 年 10 月 25 日