

财通中证香港红利等权投资指数型证券投资基金2021年第3季度报告

2021年09月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2021年10月26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2021年10月25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2021年7月1日起至9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	财通中证香港红利等权投资指数
场内简称	-
基金主代码	006658
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04月26日
报告期末基金份额总额	20,780,997.57份
投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用指数复制法。本基金按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，在保持基金资产的流动性前提下，达到有效复制标的指数的目的。将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券投资组合；将在严格控制风险的前提下进行权证投资；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；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。	
业绩比较基准	中证香港红利等权投资指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金主要投资港股通标的股票，还需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
基金管理人	财通基金管理有限公司	
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	财通中证香港红利等权投资指数A	财通中证香港红利等权投资指数C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	006658	006659
报告期末下属分级基金的份额总额	17,112,924.01份	3,668,073.56份
下属分级基金的风险收益特征	本基金为股票型基金，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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金主要投资港股通标的股票，还需承担汇率风险以及境外市场的风险。	本基金为股票型基金，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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金主要投资港股通标的股票，还需承担汇率风险以及境外市场的风险。

### §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07月01日 - 2021年09月30日)	
	财通中证香港红利等权投资指数A	财通中证香港红利等权投资指数C
1.本期已实现收益	62,653.66	12,887.63
2.本期利润	-355,806.71	25,022.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0205	0.0077
4.期末基金资产净值	16,203,380.23	3,447,529.62
5.期末基金份额净值	0.9469	0.9399

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

财通中证香港红利等权投资指数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	-2.02%	1.28%	-3.03%	1.35%	1.01%	-0.07%
过去六个月	-7.36%	1.04%	-11.02%	1.08%	3.66%	-0.04%
过去一年	9.85%	1.10%	5.76%	1.14%	4.09%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-5.31%	1.22%	-15.27%	1.21%	9.96%	0.01%

财通中证香港红利等权投资指数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	-2.09%	1.28%	-3.03%	1.35%	0.94%	-0.07%
过去六个月	-7.50%	1.04%	-11.02%	1.08%	3.52%	-0.04%
过去一年	9.52%	1.10%	5.76%	1.14%	3.76%	-0.04%

自基金合同生效起至今	-6.01%	1.22%	-15.27%	1.21%	9.26%	0.01%
------------	--------	-------	---------	-------	-------	-------

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：95%×中证香港红利等权投资指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

### 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





注：(1)本基金合同生效日为 2019 年 4 月 26 日；  
 (2)本基金建仓期为基金合同生效起 6 个月，截至建仓期末及本报告期末，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		
顾弘原	本基金的基金经理	2021-05-26	-	4年	伦敦政治学院统计学硕士，香港大学风险管理学士。曾担任香港伟亨证券有限公司分析师。2017年2月加入财通基金管理有限公司，历任量化投资一部助理研究员、研究员，现任量化投资一部基金经理。

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“离任日期”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。

## 4.2 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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合及短期国债回购交易除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为被动式指数基金开放式基金。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（短期国债回购交易除外）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

本报告期内，本基金严格遵循跟踪标的指数的投资策略，将跟踪误差控制在了指定范围之内。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通中证香港红利等权投资指数A基金份额净值为0.9469元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.02%，同期业绩比较基准收益率为-3.03%；截至报告期末财通中证香港红利等权投资指数C基金份额净值为0.9399元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.09%，同期业绩比较基准收益率为-3.03%。

#### 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个交易日基金份额持有人数量不满200人的情况出现；本基金资产净值于2019年11月6日至2021年9月30日期间连续465个工作日低于5000万元。本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

### §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	18,138,764.37	91.21
	其中：股票	18,138,764.37	91.21
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	1,571,856.20	7.90



	计		
8	其他资产	177,235.62	0.89
9	合计	19,887,856.19	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为18,138,764.37元，占基金资产净值比例92.31%。

## 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

本基金本报告期末未投资境内股票。

### 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

本基金本报告期末未投资境内股票。

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
基础材料	1,046,165.07	5.32
非日常生活消费品	1,836,630.72	9.35
能源	3,413,721.59	17.37
金融	3,855,335.04	19.62
工业	801,337.08	4.08
信息技术	1,485,879.13	7.56
公用事业	2,294,413.86	11.68
地产业	3,405,281.88	17.33
合计	18,138,764.37	92.30

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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

### 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	0836.HK	华润电力	88,000	1,645,793.34	8.38
2	1171.HK	兖州煤业股份	110,000	1,350,723.48	6.87
3	0992.HK	联想集团	120,000	836,725.46	4.26
4	0939.HK	建设银行	174,000	808,834.62	4.12

5	0144.HK	招商局港口	72,000	801,337.08	4.08
6	1398.HK	工商银行	218,000	786,358.66	4.00
7	0868.HK	信义玻璃	40,000	776,411.92	3.95
8	1088.HK	中国神华	48,500	736,150.13	3.75
9	0883.HK	中国海洋石油	97,000	703,019.33	3.58
10	1888.HK	建滔积层板	60,500	649,153.67	3.30

注：所用证券代码采用当地市场代码。

### 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

本基金本报告期末未有积极投资股票。

### 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 报告期内，本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内受到公开谴责、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	31,108.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	145,795.02
4	应收利息	332.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	177,235.62

### 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

本基金本报告期末前五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

单位：份

	财通中证香港红利等权 投资指数A	财通中证香港红利等权 投资指数C
报告期期初基金份额总额	17,647,108.62	2,998,734.38
报告期期间基金总申购份额	510,141.85	5,748,672.25
减：报告期期间基金总赎回份额	1,044,326.46	5,079,333.07
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	17,112,924.01	3,668,073.56

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)本基金基金合同生效日为2019年4月26日。

## §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

	财通中证香港红利等 权投资指数A	财通中证香港红利等 权投资指数C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,383,177.57	-
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	10,383,177.57	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	60.67	-

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2020-03-02	10,383,177.57	10,000,000.00	1000元/笔
合计			10,383,177.57	10,000,000.00	

## §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	2020-03-02 至 2021-09-30	10,383,177.57	0.00	0.00	10,383,177.57	49.96%
产品特有风险							
<p>目标指数回报与股票市场平均回报偏离的风险；目标指数波动的风险；基金投资组合回报与目标指数回报偏离的风险；目标指数变更的风险。</p> <p>在报告期内，本基金单一投资者持有的基金份额已超过20%，可能对基金运作造成如下风险：</p> <p>(1)赎回申请延缓支付的风险</p> <p>该等投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与该等投资者按同比例延缓支付赎回款项的风险。</p> <p>(2)基金净值大幅波动的风险</p> <p>该等投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>(3)基金规模过小导致的风险</p> <p>该等投资者赎回后，很可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，实现基金投资目标存在一定的不确定性。</p>							

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《证券时报》及管理人网站进行了如下信息披露：

- 1、2021年7月1日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下基金2021年半年度资产净值的公告》；
- 2、2021年7月20日披露了《财通中证香港红利等权投资指数型证券投资基金2021年第二季度报告》；
- 3、2021年8月10日披露了《财通基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金2021年风险评价结果的公告》；
- 4、2021年8月27日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构的公告》；

5、2021年8月28日披露了《财通中证香港红利等权投资指数型证券投资基金2021年中期报告》；

6、2021年9月4日披露了《财通基金管理有限公司高级管理人员变更公告》；

7、2021年9月9日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金因非港股通交易日暂停申购、赎回（转换、定期定额投资）业务的公告》；

8、2021年9月25日披露了《财通基金管理有限公司关于公司变更法定代表人并完成工商变更登记的公告》；

9、2021年9月25日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金因非港股通交易日暂停申购、赎回（转换、定期定额投资）业务的公告》；

10、2020年第一季度，本基金管理人使用风险准备金一千万元投资于本基金；

11、本报告期内，公司按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定每日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

## §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、财通中证香港红利等权投资指数型证券投资基金合同；
- 3、财通中证香港红利等权投资指数型证券投资基金托管协议；
- 4、财通中证香港红利等权投资指数型证券投资基金招募说明书及其更新；
- 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41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  
二〇二一年十月二十六日