

圆信永丰沣泰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:圆信永丰基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2023年10月25日

目录

§1 重要提示.....	3
§2 基金产品概况.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	6
4.3 公平交易专项说明.....	6
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析.....	6
4.5 报告期内基金的业绩表现.....	7
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	7
§5 投资组合报告.....	7
5.1 报告期末基金资产组合情况.....	7
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	8
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.....	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	9
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.....	10
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.....	10
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.....	10
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.....	10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	10
5.11 投资组合报告附注.....	10
§6 开放式基金份额变动.....	12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	12
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	12
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	12
§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	12
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.....	12
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	12
§9 备查文件目录.....	12
9.1 备查文件目录.....	13
9.2 存放地点.....	13
9.3 查阅方式.....	13

§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。

基金托管人兴业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

基金简称	圆信永丰沆泰
基金主代码	009054
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年04月29日
报告期末基金份额总额	15,455,456.96份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金通过对国家宏观经济政策的深入分析，在动态跟踪财政政策、货币政策的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响和预期收益风险，评估股票、债券等大类资产的估值水平和投资价值，确定投资组合的资产配置比例，并适时进行调整。本基金的投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

基金管理人	圆信永丰基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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）
1.本期已实现收益	65,306.28
2.本期利润	-313,133.26
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0200
4.期末基金资产净值	18,034,876.68
5.期末基金份额净值	1.1669

注1：本期指2023年7月1日至2023年9月30日，上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，申购费、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

注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

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	-1.69%	0.49%	-0.11%	0.17%	-1.58%	0.32%
过去六个月	-3.30%	0.49%	-0.01%	0.17%	-3.29%	0.32%
过去一年	-0.60%	0.50%	2.23%	0.19%	-2.83%	0.31%
过去三年	14.08%	0.59%	5.37%	0.23%	8.71%	0.36%
自基金合同生效起至今	16.69%	0.62%	9.51%	0.23%	7.18%	0.39%

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

圆信永丰沅泰混合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
(2020年04月29日-2023年09月30日)



§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		
林铮	本基金基金经理	2020-04-29	-	14年	厦门大学经济学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司固收投资部总监。历任厦门国贸集团投资研究员，国贸期货宏观金融期货研究员，海通期货股指期货分析师，圆信永丰基金管理有限公司专户投资部副总监、固收投资部副总监。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格。
党伟	本基金基金经理	2021-09-27	-	7年	上海复旦大学金融专业硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司权益投资部基金经理。历任圆信永丰基金管理有限公司研究部助理研

					究员、研究员。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格证。
--	--	--	--	--	---------------------------------

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在风险可控的前提下为基金份额持有人谋求最大利益。基金管理人遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、该基金基金合同的规定。基金经理对个券和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

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，基金管理人贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和《圆信永丰基金管理有限公司公平交易管理办法》的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保基金管理人管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

基金管理人各类基金资产、资产管理计划资产独立运作。对于交易所市场投资，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照价格优先、时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资，基金管理人通过交易对手控制和询价机制，严格防范对手风险并抽检价格公允性；对于申购投资行为，基金管理人遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过每季度和每年度对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，基金管理人未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，基金管理人未发现存在有可能导致不公平交易和利益输送等的异常交易行为。

基金管理人旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023年3季度，债券市场无风险利率整体呈现触底反弹的走势，收益率曲线呈现扁平化变动，利率低点出现在8月15日公开市场利率下调后。季度内对于债券市场主要影

响因素：国内经济基本面在经历二季度的放缓后，三季度无论是生产还是消费，均出现了企稳的迹象；央行延续相对宽松的货币政策，但随着稳定汇率的政策重要性提升，流动性边际收紧的现象也趋于明显，短端在8月中下旬后持续上行；三季度，利率债和专项债发行提速，在供给放量下，叠加地产政策优化的影响，融资扩张明显，宽信用进程也明显提升。

由于产品规模较小，报告期内纯债债券整体组合维持相对稳定。转债方面，随着8-9月份的调整，转债整体估值再度回到年内低位，组合适当调整配置仓位。

股票方面，本基金继续维持较高仓位精选个股的投资策略。同时加大了行业景气周期的考量，对于景气向下的部分品种减少了配置比例。基于当前经济所处的位置，以及长期行业空间的考量，本基金适当增加了军工以及医药行业配置，未来不排除进一步增加的可能性。同时基于行业变化的角度，加大了汽车的配置。整体上，当前的配置思路更加注重中长期，一些板块经过大幅的调整后以2-3年维度看，已经展现出了非常可观的上涨空间，未来本基金配置将逐步朝这个方向集中。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰沅泰基金份额净值为1.1669元，本报告期内，基金份额净值增长率为-1.69%，同期业绩比较基准收益率为-0.11%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元情形，日期范围：2023年7月1日-2023年9月30日。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

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	6,370,818.00	34.96
	其中：股票	6,370,818.00	34.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,496,556.17	63.09
	其中：债券	11,496,556.17	63.09
	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	199,817.63	1.10
	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	148,870.70	0.82
8	其他资产	5,040.93	0.03
9	合计	18,221,103.43	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	6,365,988.00	35.30
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	-	-
J	金融业	4,830.00	0.03
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	6,370,818.00	35.32

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 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	603997	继峰股份	64,500	950,730.00	5.27
2	002475	立讯精密	22,500	670,950.00	3.72
3	002920	德赛西威	3,900	560,196.00	3.11
4	605222	起帆电缆	29,200	523,556.00	2.90
5	603379	三美股份	13,000	373,230.00	2.07
6	300750	宁德时代	1,800	365,454.00	2.03
7	601799	星宇股份	2,000	304,000.00	1.69
8	002463	沪电股份	12,500	281,375.00	1.56
9	002182	宝武镁业	12,800	253,184.00	1.40
10	603035	常熟汽饰	12,000	232,560.00	1.29

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	1,008,787.79	5.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,247,812.42	12.46
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,538,840.79	8.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	3,054,012.23	16.93
7	可转债（可交换债）	3,647,102.94	20.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,496,556.17	63.75

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	102180032	21韵达股份MT N003	15,000	1,550,494.85	8.60
2	149364	21厦贸01	15,000	1,538,840.79	8.53
3	102281759	22成都环境MT N001	15,000	1,503,517.38	8.34
4	2023005	20平安人寿	12,000	1,230,384.00	6.82
5	2028013	20农业银行二级 01	10,000	1,017,428.42	5.64

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
根据基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

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
根据基金合同约定，本基金不参与权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
根据基金合同约定，本基金不参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注**5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明**

通过查阅中国证监会、国家金融监督管理总局网站公开目录“行政处罚决定”及查阅相关发行主体的公司公告，在基金管理人知悉的范围内，报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 本基金前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,790.19
2	应收证券清算款	250.74
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,040.93

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	110062	烽火转债	741,216.99	4.11
2	110079	杭银转债	523,782.62	2.90
3	113024	核建转债	401,465.25	2.23
4	113516	苏农转债	333,399.04	1.85
5	128134	鸿路转债	310,381.16	1.72
6	113060	浙22转债	187,628.34	1.04
7	127049	希望转2	163,952.92	0.91
8	123087	明电转债	123,765.62	0.69
9	128048	张行转债	117,004.30	0.65
10	127016	鲁泰转债	113,065.34	0.63
11	127005	长证转债	109,059.86	0.60
12	110075	南航转债	63,150.79	0.35
13	123157	科蓝转债	62,214.03	0.34
14	123107	温氏转债	62,088.84	0.34
15	118013	道通转债	61,956.58	0.34
16	123169	正海转债	60,648.38	0.34
17	113655	欧22转债	59,906.23	0.33

18	127035	濮耐转债	59,740.41	0.33
19	128074	游族转债	59,345.78	0.33
20	123165	回天转债	33,330.46	0.18

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未存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金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

报告期期初基金份额总额	15,810,770.18
报告期期间基金总申购份额	13,607.11
减：报告期期间基金总赎回份额	368,920.33
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	15,455,456.96

§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

本报告期内，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

本报告期内，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

报告期内不存在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

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准圆信永丰沅泰混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《圆信永丰沅泰混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《圆信永丰沅泰混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、报告期内在规定报刊上披露的各项公告；
- 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。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人圆信永丰基金管理有限公司。

咨询电话：4006070088

公司网址：<http://www.gtsfund.com.cn>

圆信永丰基金管理有限公司

2023年10月25日