

圆信永丰沣泰混合型证券投资基金

2024年第2季度报告

2024年06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:2024年07月19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.....	13
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.....	13
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	13
§9 备查文件目录.....	13
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2024年7月18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2024年4月1日起至2024年6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	13,933,248.57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（2024年04月01日 - 2024年06月30日）
1.本期已实现收益	498,262.40
2.本期利润	-109,206.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0077
4.期末基金资产净值	16,449,408.19
5.期末基金份额净值	1.1806

注1：本期指2024年4月1日至2024年6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	-0.73%	0.76%	1.13%	0.15%	-1.86%	0.61%
过去六个月	2.17%	0.89%	3.40%	0.18%	-1.23%	0.71%
过去一年	-0.54%	0.70%	2.46%	0.17%	-3.00%	0.53%
过去三年	-0.35%	0.58%	3.37%	0.21%	-3.72%	0.37%
自基金合同生效起至今	18.06%	0.65%	12.33%	0.22%	5.73%	0.43%

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-2024年06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		
党伟	本基金基金经理	2021-09-27	-	8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。
林铮	本基金基金经理	2020-04-29	2024-04-03	15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

权益方面，2024年2季度权益市场表现平淡，上证综指下跌2.43%，深证成指下跌5.87%。深证成指连续第五个季度收跌。从经济基本情况看，二季度国内消费走淡，出口还可以，地产政策支持力度进一步加强。

基金组合方面，基于消费的表现平淡，本基金持仓有所调整，降低了部分消费相关的行业持仓，增加了部分周期相关行业。新能源板块2季度调整比较多，车相关消费比较弱，光伏产业链盈利压力大，尽管短期调整大，但是仍然有好的方面，比如国内风光招标数据依然亮眼，国内外储能依然高速增长，未来随着供给端的逐步改善，预计产业盈利会大幅提升。电子行业越来越多的公司走出业绩底部，相关标的2季度表现不错。

总体上，本基金依然维持精选个股策略，优选中长期预期收益率合理的标的进行布局。

可转债方面，季初转债整体市场有一波上行，到了季末由于各债评级逐步披露，在权益市场下行的背景下，叠加个别转债评级下调，引发可转债市场流动性风险，整体上2季度可转债市场收跌。

基于转债市场的波动以及对未来整体经济的信心，本基金借此机会适当提升了转债持仓。

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1.1806元，本报告期内，基金份额净值增长率为-0.73%，同期业绩比较基准收益率为1.13%。

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：2024年4月1日-2024年6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。本基金2024年的信息披露费用、审计费用、基金份额持有人大会费用等固定费用，由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。

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	5,648,022.25	33.96
	其中：股票	5,648,022.25	33.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,349,812.69	56.21

	其中：债券	9,349,812.69	56.21
	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	1,454,000.00	8.74
	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	84,613.94	0.51
8	其他资产	96,031.93	0.58
9	合计	16,632,480.81	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	508,350.00	3.09
C	制造业	5,139,672.25	31.25
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	-	-
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	5,648,022.25	34.34

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	605222	起帆电缆	45,200	693,368.00	4.22
2	688408	中信博	6,059	557,912.72	3.39
3	603997	继峰股份	53,000	542,190.00	3.30
4	601899	紫金矿业	15,000	263,550.00	1.60
5	688212	澳华内镜	6,369	254,823.69	1.55
6	002138	顺络电子	9,200	252,632.00	1.54
7	603993	洛阳钼业	28,800	244,800.00	1.49
8	000933	神火股份	12,000	242,760.00	1.48
9	688772	珠海冠宇	16,270	242,423.00	1.47
10	002182	宝武镁业	21,280	240,038.40	1.46

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	915,170.79	5.56
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）	8,434,641.90	51.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,349,812.69	56.84

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	019685	22国债20	9,000	915,170.79	5.56
2	111000	起帆转债	5,000	574,424.66	3.49
3	118024	冠宇转债	4,500	493,442.88	3.00
4	113045	环旭转债	3,700	439,519.55	2.67
5	123107	温氏转债	3,200	403,836.93	2.46

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的情形，也没有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	3,914.98
2	应收证券清算款	92,016.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	99.99
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	96,031.93

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	111000	起帆转债	574,424.66	3.49
2	118024	冠宇转债	493,442.88	3.00
3	113045	环旭转债	439,519.55	2.67
4	123107	温氏转债	403,836.93	2.46
5	127089	晶澳转债	379,479.94	2.31
6	113623	风21转债	371,538.49	2.26
7	118023	广大转债	354,530.14	2.16
8	118034	晶能转债	351,443.24	2.14
9	113061	拓普转债	332,356.09	2.02
10	123161	强联转债	324,549.12	1.97
11	127049	希望转2	310,507.73	1.89
12	128141	旺能转债	309,215.84	1.88
13	127084	柳工转2	299,008.33	1.82
14	123144	裕兴转债	295,704.11	1.80
15	113640	苏利转债	295,634.85	1.80
16	118000	嘉元转债	279,512.47	1.70
17	128119	龙大转债	278,521.64	1.69
18	127045	牧原转债	260,368.55	1.58

19	110081	闻泰转债	247,755.62	1.51
20	113649	丰山转债	245,396.92	1.49
21	118025	奕瑞转债	226,155.44	1.37
22	118005	天奈转债	199,779.45	1.21
23	118013	道通转债	179,297.66	1.09
24	128081	海亮转债	162,758.75	0.99
25	128134	鸿路转债	160,636.85	0.98
26	113033	利群转债	152,488.52	0.93
27	123157	科蓝转债	145,916.10	0.89
28	113677	华懋转债	140,660.89	0.86
29	110075	南航转债	123,984.14	0.75
30	113639	华正转债	96,217.00	0.58

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

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	14,255,404.72
报告期期间基金总申购份额	1,094,363.78
减：报告期期间基金总赎回份额	1,416,519.93
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	13,933,248.57

§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

2024年07月19日