

京管泰富京元一年定期开放债券型发起式
证券投资基金
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：北京京管泰富基金管理有限责任公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

报告送出日期：2024 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 21 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 京管泰富京元一年定开债券发起 |
| 基金主代码 | 007156 |
| 基金运作方式 | 契约型、定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 12 月 28 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 7,977,359,397.71 份 |
| 投资目标 | 本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。 |
| 投资策略 | 本基金的投资策略分为封闭期投资策略和开放期投资策略。封闭期的投资策略包括资产配置策略、久期策略、骑乘策略、期限结构配置策略、类属配置策略、信用债券（含资产支持证券）投资策略和息差策略。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价（总值）指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型证券投资基金，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 北京京管泰富基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 北京银行股份有限公司 |

§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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 63,227,656.39 |
| 2. 本期利润 | -9,893,324.72 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0012 |
| 4. 期末基金资产净值 | 8,036,627,378.44 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0074 |

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。

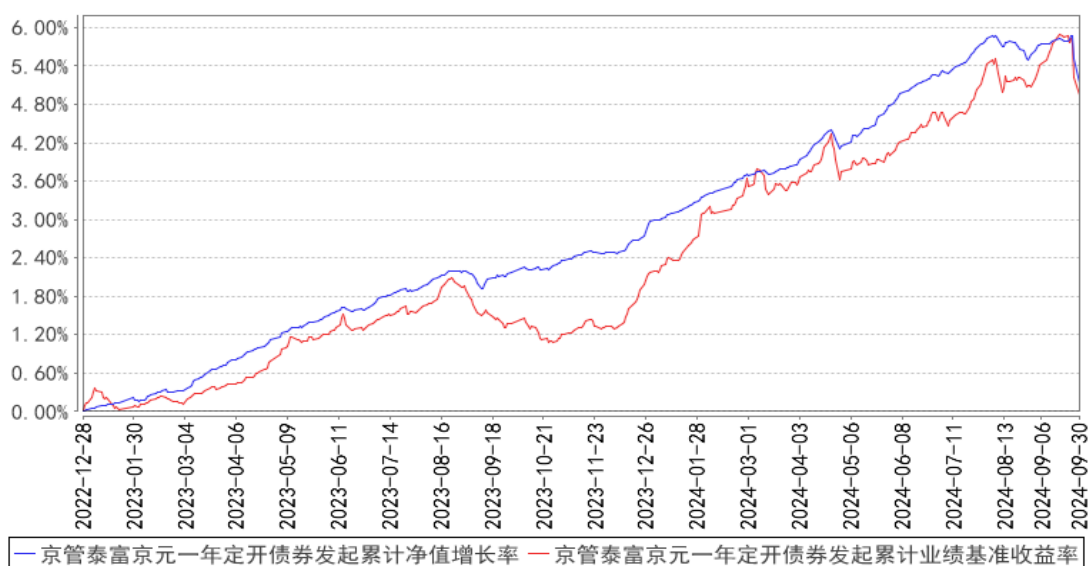
3.2 基金净值表现

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 | -0.13% | 0.07% | 0.26% | 0.10% | -0.39% | -0.03% |
| 过去六个月 | 1.22% | 0.06% | 1.32% | 0.09% | -0.10% | -0.03% |
| 过去一年 | 2.90% | 0.04% | 3.53% | 0.07% | -0.63% | -0.03% |
| 自基金合同 生效起至今 | 5.13% | 0.04% | 4.94% | 0.06% | 0.19% | -0.02% |

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

京管泰富京元一年定开债券发起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



- 注：1. 本基金基金合同的生效日为 2022 年 12 月 28 日。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例均符合合同约定；
2. 本基金业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率。

§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 | | |
| 王沫尘 | 本基金基金经理、固定收益投资部总经理 | 2022 年 12 月 28 日 | - | 5 年 | 王沫尘，北京大学经济学硕士，持有基金从业资格证。2022 年 11 月加入公司。2022 年 12 月 28 日至今，任京管泰富京元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 26 日至今，任京管泰富京诚 12 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。曾在北京股权交易中心创新部历任经理、副总监；在北京顺隆私募债券投资基金管理有限公司历任副总监、投资一部负责人、投资一部总经理；在顺隆资产管理（北京）有限公司任投资经理。 |

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准，对于首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日期。证券从业年限以从事证券、基金业务相关工作的时间为计算标准。

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

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》和相关法律法规，以及《基金合同》、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严控风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，本基金的投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，没有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

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《公平交易管理办法》《异常交易监控管理办法》，对研究、决策、交易执行等各个环节做出了明确具体的规定并严格执行。在保证本基金管理人管理的所有投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议、实施投资决策、交易执行等方面得到公平对待，并对买卖债券、股票的价格和市场价格差距较大，可能存在利益输送、操纵股价等违法违规情况进行监控。

本报告期内，公平交易制度执行情况良好，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，我国的消费及出口呈现温和复苏态势，地产投资对经济增长的贡献降低，房价仍在筑底进程中，地方政府聚焦于化债工作，通胀水平保持低位。

报告期内，流动性仍然维持合理充裕，货币政策保持积极，政策利率和准备金率均有所下行且后续仍有下行空间。同时，信用利差及期限利差有所走扩。

报告期内基金继续保持稳健的投资策略，严格控制账户久期和杠杆水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0074 元，报告期内基金份额净值增长率为-0.13%，同期

业绩比较基准收益率为 0.26%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内未出现基金持有人数或基金资产净值预警情形。

§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 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 10,759,151,419.93 | 98.61 |
| | 其中：债券 | 10,093,824,399.12 | 92.51 |
| | 资产支持证券 | 665,327,020.81 | 6.10 |
| 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计 | 151,075,779.76 | 1.38 |
| 8 | 其他资产 | 290,021.40 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 10,910,517,221.09 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 | 618,917,119.57 | 7.70 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 3,996,380,490.18 | 49.73 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 2,036,417,740.85 | 25.34 |
| 5 | 企业短期融资券 | 71,873,743.17 | 0.89 |
| 6 | 中期票据 | 3,123,875,645.90 | 38.87 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |

| | | | |
|----|------|-------------------|--------|
| 8 | 同业存单 | 246,359,659.45 | 3.07 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 10,093,824,399.12 | 125.60 |

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 | 2400002 | 24 特别国债 02 | 6,000,000 | 618,917,119.57 | 7.70 |
| 2 | 241412 | 24 招证 C8 | 3,000,000 | 296,642,745.21 | 3.69 |
| 3 | 222380010 | 23 青岛银行绿债 01 | 2,700,000 | 279,996,196.72 | 3.48 |
| 4 | 102481149 | 24 首开 MTN003 | 2,600,000 | 266,701,589.04 | 3.32 |
| 5 | 148085 | 22 广发 C1 | 2,250,000 | 231,525,123.28 | 2.88 |

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 263050 | 工鑫 32A | 1,660,000 | 166,329,816.98 | 2.07 |
| 2 | 263116 | 工鑫 23B2 | 1,130,000 | 112,997,987.67 | 1.41 |
| 3 | 262636 | 24 置地 1A | 820,000 | 82,330,624.00 | 1.02 |
| 4 | 262964 | 23 电 6 优 | 810,000 | 81,096,281.26 | 1.01 |
| 5 | 262531 | 24 核 1A1 | 400,000 | 40,156,160.00 | 0.50 |
| 6 | 263076 | 四航 2 优 A | 260,000 | 26,044,876.71 | 0.32 |
| 7 | 2489137 | 24 鼎柚 2A | 200,000 | 20,054,295.89 | 0.25 |
| 8 | 262571 | 中交 9A1 | 280,000 | 17,957,626.94 | 0.22 |
| 9 | 262172 | 工瑞 7A1 | 194,000 | 15,524,260.35 | 0.19 |
| 10 | 262173 | 工瑞 7A2 | 156,000 | 15,508,156.09 | 0.19 |

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国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

在报告编制日前一年内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京首都开发股份有限公

司、青岛银行股份有限公司出现了受到处罚的情况。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期内未进行股票投资。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 290,021.40 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 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 | 290,021.40 |

5.10.4 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可转换债券。

5.10.5 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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 7,977,359,397.71 |
| 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 | 7,977,359,397.71 |

§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

本报告期内管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内管理人未运用固有资金投资本基金。

§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 | - | - | - | - | - |
| 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 | 10,000,000.00 | 0.1254 | 10,000,000.00 | 0.1254 | 不少于三年 |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,000.00 | 0.1254 | 10,000,000.00 | 0.1254 | - |

§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 | 20240701-20240930 | 4,999,999,000.00 | - | - | 4,999,999,000.00 | 62.6774 |
| | 2 | 20240701-20240930 | 2,967,360,397.71 | - | - | 2,967,360,397.71 | 37.1973 |

产品特有风险

1. 本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；
2. 大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
3. 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；
4. 单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
5. 根据基金合同约定，基金合同生效满 3 年后，若单一机构投资者赎回后，本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止

基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会；

6. 大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

7. 大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

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. 中国证监会准予京管泰富京元一年定期开放债券型发起式证券投资基金募集注册的文件
2. 《京管泰富京元一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
3. 《京管泰富京元一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金托管协议》
4. 《京管泰富京元一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批准文件、营业执照
6. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

10.2 存放地点

基金管理人地址：北京市西城区西直门南小街国英园 9 号楼。

10.3 查阅方式

1. 投资者可登录基金管理人官方网站（www.cdbsfund.com）或在营业时间内到北京京管泰富基金管理有限责任公司免费查阅上述文件。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。

2. 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人北京京管泰富基金管理有限责任公司。
客户服务中心电话：400-898-3299。

北京京管泰富基金管理有限责任公司

2024 年 10 月 25 日