

圆信永丰兴益三个月定期开放债券型证券投资基金

2022年第4季度报告

2022年12月31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01月20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.....	7
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.....	8
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	8
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.....	9
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.....	9
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.....	9
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.....	9
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	9
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	9
5.11 投资组合报告附注.....	9
§6 开放式基金份额变动.....	10
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	11
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	11
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	11
§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	11
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.....	11
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	11
§9 备查文件目录.....	12
9.1 备查文件目录.....	12
9.2 存放地点.....	12
9.3 查阅方式.....	12

§ 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1月19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2022年10月1日起至2022年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	圆信永丰兴益三个月定开债
基金主代码	015284
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2022年09月15日
报告期末基金份额总额	701,318,888.15份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>本基金通过综合分析国内外宏观经济运行状况和金融市场运行趋势等因素，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。</p> <p>本基金的封闭期投资策略还包括债券资产配置策略、信用类固定收益类证券的投资策略、息差策略、互换策略、回购策略、流动性管理策略。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，</p>

	将主要投资于高流动性的投资品种。
业绩比较基准	中债-国债及政策性银行债指数收益率*80%+一年期定期存款利率（税后）*20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、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（2022年10月01日 - 2022年12月31日）
1. 本期已实现收益	-165,989.99
2. 本期利润	389,266.04
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0008
4. 期末基金资产净值	701,394,479.71
5. 期末基金份额净值	1.0001

注1：本期指2022年10月1日至2022年12月31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	0.14%	0.07%	-0.28%	0.09%	0.42%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.01%	0.07%	-0.60%	0.09%	0.61%	-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

圆信永丰兴益三个月定期开放债券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



注：自基金合同生效后，截止报告期末，本基金成立不满一年；本基金仍处于建仓期。

§ 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		
刘莎莎	本基金基金经理	2022-09-15	-	12年	南京财经大学金融学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司固收投资部基金经理。历任江南农村商业银行公司业务部办事员、资金业务部业务主管、风险管理部业务主管，圆信永丰基金管理有限公司固收投资部货币基金经理

					助理。国籍：中国。获得的相关业务资格：基金从业资格证。
康芳华	本基金基金经理	2022-09-24	-	10年	华东师范大学金融学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司固收投资部基金经理。历任上海大智慧股份有限公司产品经理，上海新世纪资信评估投资服务有限公司分析师，圆信永丰基金管理有限公司固收投资部信用研究员。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格。

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，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。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

2022年国内债市走势主要受国内经济恢复、货币政策、疫情及防疫相关措施等因素的影响，虽然欧美等发达国家大幅加息，但是国内冲击有限，汇率波动较大。去年10月之前，受央行超预期降息、经济恢复偏慢、宽信用效果偏弱、疫情反复和资金面偏松等因素影响，债市收益率整体下行，10年期国债收益率由年初的2.8%下行至2.65%左右。11月以来防疫优化政策及地产政策频出令市场对经济恢复的预期转暖，债市出现大幅调整，10年期国债收益率快速上行至2.85%上方。由于理财净值波动，引起理财产品巨额赎回，信用债特别是金融债收益大幅上行。

本基金于2022年9月15日成立，成立初期债券收益率处于较低水平，产品初期配置的杠杆和久期都相对较短，后续随着利率调整，资产配置做了适当调整，整体上受债券收益率大幅上行的冲击相对较小。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰兴益三个月定开债基金份额净值为1.0001元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.14%，同期业绩比较基准收益率为-0.28%。

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元情形。

§ 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	579,681,174.51	82.61
	其中：债券	579,681,174.51	82.61

	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	120,424,063.92	17.16
	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	1,602,061.43	0.23
8	其他资产	3,971.10	0.00
9	合计	701,711,270.96	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

根据基金合同约定，本基金不参与股票交易。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

根据基金合同约定，本基金不参与股票交易。

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

根据基金合同约定，本基金不参与股票交易。

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	10,083,498.63	1.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	509,948,951.49	72.71
	其中：政策性金融债	449,427,486.84	64.08
4	企业债券	59,648,724.39	8.50
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	579,681,174.51	82.65

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	190305	19进出05	1,200,000	124,669,873.97	17.77
2	220214	22国开14	600,000	59,619,050.00	8.50
3	190404	19农发04	500,000	51,997,643.84	7.41
4	092203007	22进出清发007	500,000	49,710,888.89	7.09
5	200212	20国开12	400,000	41,417,906.85	5.91

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

根据基金合同约定，本基金不参与资产支持证券投资。

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

根据基金合同约定，本基金不参与股指期货投资。

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、中国银保监会网站公开目录“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除19进出05（190305.IB）、22进出清发007（092203007.IB）的发行主体中国进出口银行、22国开14（220214.IB）、20国开12（200212.IB）的发行主体国家开发银行、19农发04（190404.IB）的发行主体中国农业发展银行外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。

2022年3月21日，中国进出口银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在多项违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会出具行政处罚（银保监罚决字[2022]9号），罚款420万元。

2022年3月21日，国家开发银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在多项违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会出具行政处罚（银保监罚决字[2022]8号），罚款440万元。

2022年3月21日，中国农业发展银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在多项违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会出具行政处罚（银保监罚决字[2022]10号），罚款480万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2 根据基金合同约定，本基金不参与股票投资。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,971.10
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	3,971.10

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

根据基金合同约定，本基金不参与可转换债券投资。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

根据基金合同约定，本基金不参与股票投资。

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	500,002,968.41
报告期期间基金总申购份额	451,313,919.74
减：报告期期间基金总赎回份额	249,998,000.00

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	701,318,888.15

§ 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

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	1,000,700.49
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	1,000,700.49
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.14

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	2022-12-29	1,000,700.49	1,003,000.00	0.0030
合计			1,000,700.49	1,003,000.00	

§ 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	20221001-20221231	249,999,000.00	0.00	0.00	249,999,000.00	35.65%
	2	20221001-20221219	149,999,000.00	0.00	149,999,000.00	0.00	0.00%
	3	20221229-20221231	0.00	350,244,170.92	0.00	350,244,170.92	49.94%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

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兴益三个月定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《圆信永丰兴益三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《圆信永丰兴益三个月定期开放债券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01月20日