

# 同泰恒盛债券型证券投资基金

## 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：同泰基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 2024 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	同泰恒盛债券
基金主代码	017622
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 20 日
报告期末基金份额总额	781,910,166.69 份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过自上而下的分析，形成对不同大类资产市场的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定固定收益类资产、权益类资产和现金等的配置比例，并随着市场运行状况以及各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，力争有效控制基金资产运作风险，提高基金资产风险调整后收益。
业绩比较基准	中债-新综合财富（总值）收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+中证港股通综合指数收益率×2%
风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。 本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	同泰基金管理有限公司

基金托管人	平安银行股份有限公司		
下属分类基金的基金简称	同泰恒盛债券 A	同泰恒盛债券 C	同泰恒盛债券 D
下属分类基金的交易代码	017622	017623	020709
报告期末下属分类基金的份额总额	1,043,088.45 份	1,035,118.05 份	779,831,960.19 份

注：本基金 D 类基金份额于 2024 年 3 月 4 日起生效。

### § 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）		
	同泰恒盛债券 A	同泰恒盛债券 C	同泰恒盛债券 D
1. 本期已实现收益	13,799.41	239,792.21	429,381.90
2. 本期利润	8,685.51	136,838.86	-1,578,886.15
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0083	0.0078	-0.0208
4. 期末基金资产净值	1,169,841.72	1,035,872.81	874,552,136.89
5. 期末基金份额净值	1.1215	1.0007	1.1215

注：1、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。

2、以上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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

#### 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

###### 同泰恒盛债券 A

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	0.72%	0.10%	2.34%	0.12%	-1.62%	-0.02%
过去六个月	1.49%	0.09%	3.94%	0.10%	-2.45%	-0.01%
过去一年	2.96%	0.08%	6.65%	0.10%	-3.69%	-0.02%
自基金合同生效起至今	30.26%	1.16%	7.50%	0.10%	22.76%	1.06%

###### 同泰恒盛债券 C

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	0.71%	0.10%	2.34%	0.12%	-1.63%	-0.02%
过去六个月	1.44%	0.09%	3.94%	0.10%	-2.50%	-0.01%
过去一年	2.82%	0.08%	6.65%	0.10%	-3.83%	-0.02%
自基金合同生效起至今	29.97%	1.16%	7.50%	0.10%	22.47%	1.06%

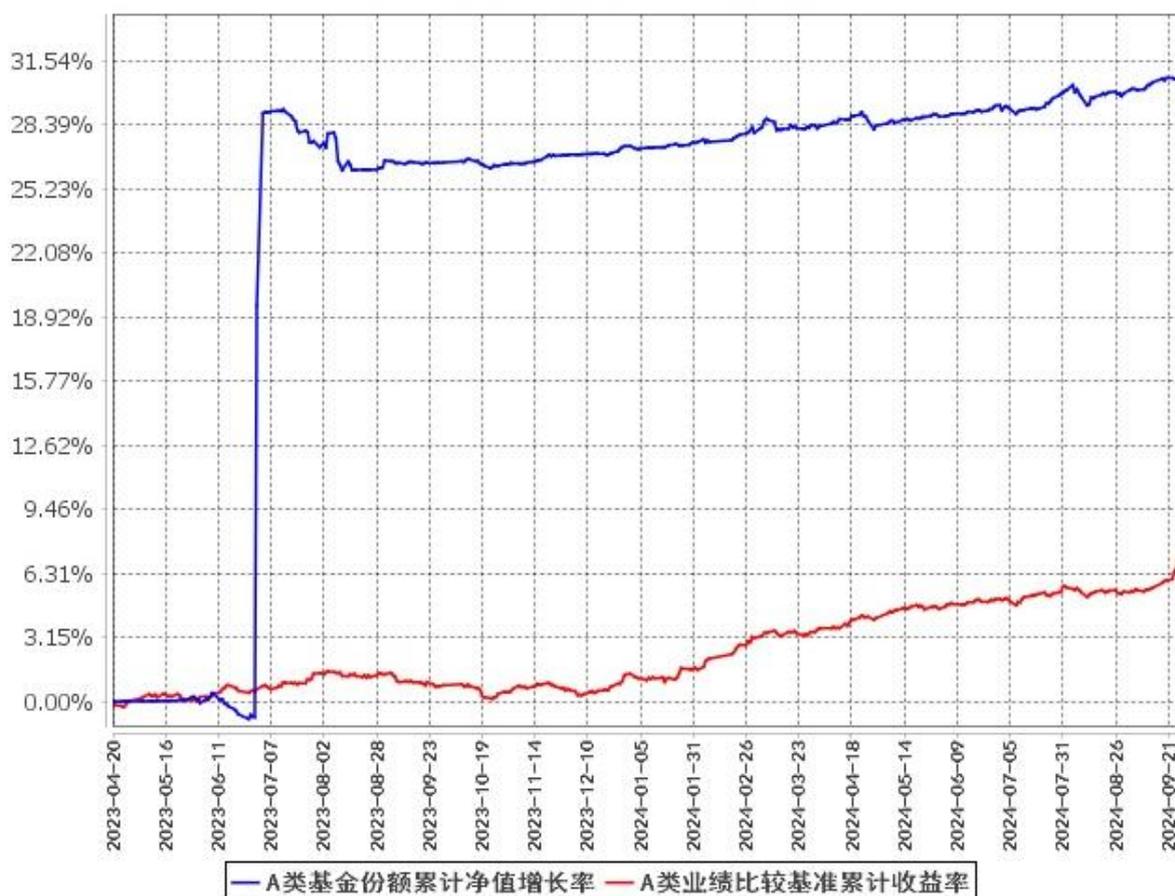
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

同泰恒盛债券 D

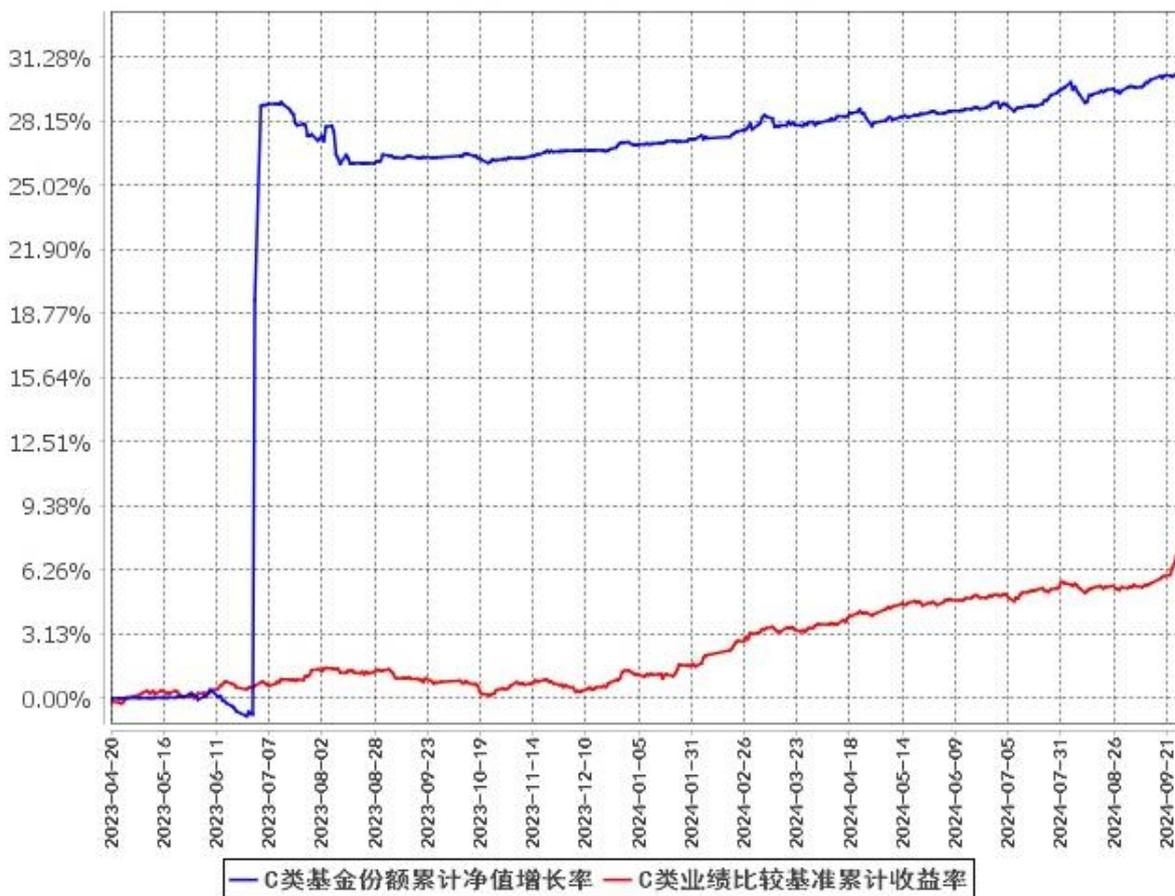
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.72%	0.10%	2.34%	0.12%	-1.62%	-0.02%
过去六个月	1.49%	0.09%	3.94%	0.10%	-2.45%	-0.01%
自基金合同生效起至今	1.61%	0.09%	4.17%	0.10%	-2.56%	-0.01%

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

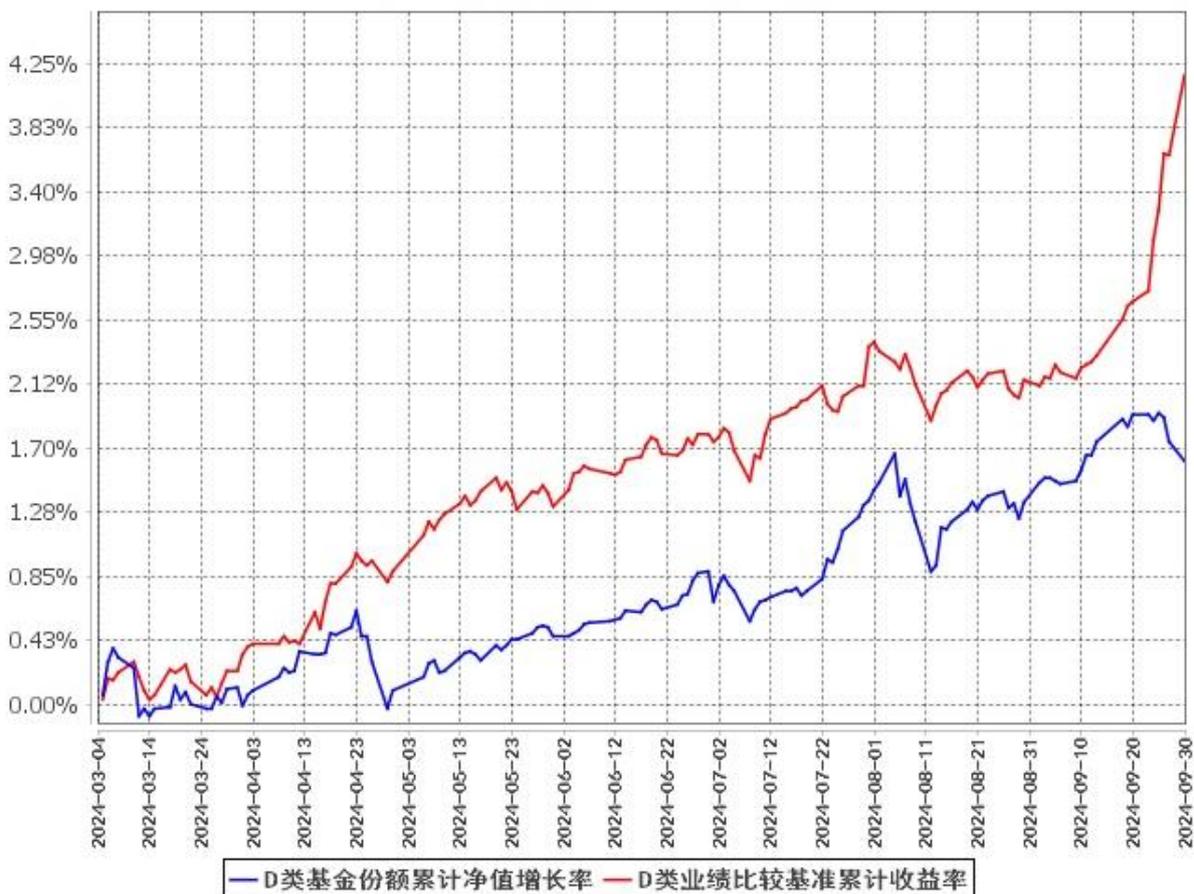
A类基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2023年4月20日至2024年9月30日)



C类基金份额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  
(2023年4月20日至2024年9月30日)



D类基金份额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  
(2024年3月4日至2024年9月30日)



注：(1) 本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

(2) 自 2024 年 3 月 4 日起，本基金增设 D 类份额类别，份额首次确认日为 2024 年 3 月 5 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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		
马毅	本基金基金经理, 固定收益部总监	2023 年 12 月 6 日	-	16	马毅先生, 中国国籍, 硕士。曾任华泰资产管理有限公司投资经理、富国基

				<p>金管理有限公司年金投资经理兼研究员、摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司)基金经理、浙商证券股份有限公司自营分公司ED(执行总监)、上海玖歌投资管理有限公司量化多策略负责人兼投资经理。2023 年 10 月加入同泰基金管理有限公司, 现任固定收益部总监、同泰恒兴纯债债券型证券投资基金基金经理、同泰泰亨中短债债券型证券投资基金基金经理、同泰恒盛债券型证券投资基金基金经理、同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金经理、同泰同欣混合型证券投资基金基金经理、同泰泰裕三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、同泰恒利纯债债券型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

1、基金的首任基金经理, 其“任职日期”为基金合同生效日, 其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

2、基金的非首任基金经理, 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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 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

本报告期, 无此情况。

#### 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, 基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的前提下, 为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内, 基金运作整体合法合规。

### 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，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且不存在其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年三季度，国内利率市场整体呈现多头震荡行情，其中多头因素包括：月度经济金融数据反映内需偏弱、国内及美联储的降息预期及落地、人民币汇率走强等；空头因素包括：央行关于利率风险警示及大行卖债操作、央行等三部委高质量发展发布会及 9 月政治局会议的积极政策预期影响、季末股市大涨跷跷板效应等。三季度国内股市主要以调整为主，季末受积极政策预期影响而大涨。

报告期内，本基金重点投资利率债，保持中性久期，8 月下旬适度参与了转债交易。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末同泰恒盛债券 A 的基金份额净值为 1.1215 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.72%；截至本报告期末同泰恒盛债券 C 的基金份额净值为 1.0007 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.71%；截至本报告期末同泰恒盛债券 D 的基金份额净值为 1.1215 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.72%；同期业绩比较基准收益率为 2.34%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	734,658,783.24	83.77
	其中：债券	734,658,783.24	83.77
	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计	127,402,892.73	14.53
8	其他资产	14,936,039.81	1.70
9	合计	876,997,715.78	100.00

注：存放在证券经纪商的证券交易资金账户中的证券交易结算资金统计在“其他资产”内的“存出保证金”项下。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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通过港股通交易机制投资的港股。

## 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

### 5.3.1 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

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	1,928,963.18	0.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	732,729,820.06	83.57
	其中：政策性金融债	732,729,820.06	83.57
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	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	734,658,783.24	83.79

### 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	220208	22 国开 08	1,500,000	154,422,863.01	17.61
2	240203	24 国开 03	1,000,000	102,855,081.97	11.73
3	150314	15 进出 14	1,000,000	102,270,246.58	11.66
4	240421	24 农发 21	1,000,000	100,080,136.99	11.41
5	240413	24 农发 13	1,000,000	100,075,205.48	11.41

### 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

本基金的投资范围不包括股指期货。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的投资范围不包括股指期货。

### 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

在法律法规允许的范围内，本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，投资于国债期货合约，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	376,188.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,559,851.04
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	14,936,039.81

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	同泰恒盛债券 A	同泰恒盛债券 C	同泰恒盛债券 D
报告期期初基金份额总额	1,041,938.44	26,911,218.90	21,408,816.09
报告期期间基金总申购份额	191,787.55	336,491.47	779,823,332.42
减：报告期期间基金总赎回份额	190,637.54	26,212,592.32	21,400,188.32
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	1,043,088.45	1,035,118.05	779,831,960.19

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

## § 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

本报告期内本基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期无运用固有资金投资本基金的交易明细。

## § 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	20240701-20240704	21,400,188.32	25,507,779.95	21,400,188.32	25,507,779.95	3.26%
	2	20240701-20240825	25,718,499.10	-	25,718,499.10	-	0.00%
	3	20240904-20240924	-	51,015,814.98	-	51,015,814.98	6.52%
	4	20240904-20240924	-	51,015,814.98	-	51,015,814.98	6.52%
	5	20240925-20240930	-	254,129,351.97	-	254,129,351.97	32.50%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动等风险，此外，还存在因巨额赎回或集中赎回导致连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，基金合同终止的风险。

## 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、《同泰恒盛债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《同泰恒盛债券型证券投资基金托管协议》；
- 3、报告期内同泰恒盛债券型证券投资基金公告的各项原稿。

### 9.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的住所或办公场所。

### 9.3 查阅方式

投资者可登录中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>) 或者基金管理人网站 ([www.tongtaiamc.com](http://www.tongtaiamc.com)) 查阅, 或在营业时间内至基金管理人住所或办公场所免费查阅。

同泰基金管理有限公司

2024 年 10 月 24 日