

圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金

2024年第3季度报告

2024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:国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期:2024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	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	7
4.3 公平交易专项说明	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	8
4.5 报告期内基金的业绩表现	8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	8
§5 投资组合报告	8
5.1 报告期末基金资产组合情况	8
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	9
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	11
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	11
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	12
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	12
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	12
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	12
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	12
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	12
5.11 投资组合报告附注	12
§6 开放式基金份额变动	13
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	14
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	14
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	14
§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况	14
§9 影响投资者决策的其他重要信息	15
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	15
9.2 影响投资者决策的其他重要信息	15
§10 备查文件目录	15
10.1 备查文件目录	15
10.2 存放地点	15
10.3 查阅方式	15

§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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024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2024年7月1日起至2024年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	圆信永丰中证500指数增强发起
基金主代码	013878
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月01日
报告期末基金份额总额	81,588,840.43份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。本基金的投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生产品投资策略、参与融资与转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成

	份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资香港联合交易所上市的股票，将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。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。	
基金管理人	圆信永丰基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	圆信永丰中证500指数增强发起A	圆信永丰中证500指数增强发起C
下属分级基金的交易代码	013878	013879
报告期末下属分级基金的份额总额	76,587,923.78份	5,000,916.65份

§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07月01日 - 2024年09月30日)	
	圆信永丰中证500指数增强发起A	圆信永丰中证500指数增强发起C
1.本期已实现收益	-3,845,960.23	-249,748.80
2.本期利润	6,716,440.40	436,839.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0869	0.0874
4.期末基金资产净值	62,904,526.68	4,072,672.68
5.期末基金份额净值	0.8213	0.8144

注1：本期指2024年7月1日至2024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

圆信永丰中证500指数增强发起A净值表现

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	12.09%	1.76%	15.40%	1.90%	-3.31%	-0.14%
过去六个月	7.47%	1.44%	8.29%	1.56%	-0.82%	-0.12%
过去一年	2.42%	1.39%	1.03%	1.50%	1.39%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-17.87%	1.18%	-19.62%	1.25%	1.75%	-0.07%

圆信永丰中证500指数增强发起C净值表现

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	12.02%	1.76%	15.40%	1.90%	-3.38%	-0.14%
过去六个月	7.33%	1.44%	8.29%	1.56%	-0.96%	-0.12%
过去一年	2.12%	1.38%	1.03%	1.50%	1.09%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-18.56%	1.18%	-19.62%	1.25%	1.06%	-0.07%

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

圆信永丰中证500指数增强发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年12月01日-2024年09月30日)



圆信永丰中证500指数增强发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年12月01日-2024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		
崔长峰	本基金基金经理	2021-12-01	-	11年	上海交通大学金融学博士，现任圆信永丰基金管理有

					限公司权益投资部基金经理。历任平安资产管理公司量化投资部投资经理，圆信永丰基金管理有限公司专户量化投资部总监、专户一部总监。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遵规守信情况的说明

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、私募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

2024年三季度，大部分时间市场处于下跌状态，但在季度末迎来大幅上涨。上证指数上涨12.44%，深证成指上涨19.00%，沪深300上涨16.07%，中证500上涨16.19%，中证1000上涨16.60%，中证2000上涨17.67%，中证红利上涨6.43%。表现较好的行业包括非银金融、房地产、商贸零售、社会服务、计算机等，表现较差的行业包括煤炭、石油石化、公用事业、农林牧渔、银行等。风格上，反转、高beta表现较好，而红利、低波总体表现不佳，反映市场在底部拉升初期偏好超跌股。年初以来，基金A类累计取得超额收益1.28%，跟踪误差3.8%。本季度，基金按量化模型进行投资，持仓组合在风格暴露上相对平衡，略偏低波和价值。

当前，国内流动性宽松，股市成交量相比之前有明显提升，市场的风险偏好有所提升。美联储开启降息后，市场预期未来仍有继续降息的可能。近期政府密集推出一系列货币和财政政策，稳增长的预期较强。展望四季度，我们预期大盘指数将有比较确定性的机会。红利是未来长期都有机会的风格，但短期应逐渐增加对成长股的配置。

本基金作为指数增强基金，以量化模型为依托，对股票的基本面和市场面信息构建选股模型，捕捉长期基本面优秀，现金流良好，增长稳健，且被市场低估的股票构造投资组合。在风险控制方面，控制组合相对基准指数在主要风险指标上的敞口暴露，保持跟踪误差在目标范围之内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰中证500指数增强发起A基金份额净值为0.8213元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.09%，同期业绩比较基准收益率为15.40%；截至报告期末圆信永丰中证500指数增强发起C基金份额净值为0.8144元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.02%，同期业绩比较基准收益率为15.40%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，基金合同生效日为2021年12月1日，截至本报告期末生效未满足三年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§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	63,596,441.45	93.17

	其中：股票	63,596,441.45	93.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,168,471.78	4.64
	其中：债券	3,168,471.78	4.64
	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	570,810.76	0.84
8	其他资产	919,230.30	1.35
9	合计	68,254,954.29	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（指数投资）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	427,475.00	0.64
B	采矿业	3,051,612.00	4.56
C	制造业	34,259,540.85	51.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,821,523.00	4.21
E	建筑业	490,625.00	0.73
F	批发和零售业	1,746,860.96	2.61
G	交通运输、仓储和邮政业	1,341,783.00	2.00
H	住宿和餐饮业	208,258.00	0.31
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	4,359,952.04	6.51
J	金融业	4,331,740.00	6.47
K	房地产业	686,756.00	1.03
L	租赁和商务服务业	343,212.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	319,356.00	0.48

N	水利、环境和公共设施管理业	17,400.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	125,596.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	1,450,084.00	2.17
S	综合	-	-
	合计	55,981,773.85	83.58

5.2.2 报告期末（积极投资）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	331,914.00	0.50
C	制造业	5,633,102.60	8.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	136,576.00	0.20
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	371,851.00	0.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	379,807.00	0.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	255,519.00	0.38
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	175,119.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	330,779.00	0.49
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	7,614,667.60	11.37

5.2.3 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 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 报告期末指数投资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	002128	电投能源	45,500	901,355.00	1.35
2	601216	君正集团	186,200	854,658.00	1.28
3	002595	豪迈科技	14,200	657,176.00	0.98
4	601990	南京证券	65,800	636,944.00	0.95
5	600208	衢州发展	238,400	631,760.00	0.94
6	001872	招商港口	27,600	626,244.00	0.94
7	300002	神州泰岳	48,200	601,054.00	0.90
8	600131	国网信通	30,400	598,880.00	0.89
9	002984	森麒麟	21,300	584,259.00	0.87
10	600642	申能股份	68,000	580,720.00	0.87

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603507	振江股份	14,200	352,160.00	0.53
2	601121	宝地矿业	51,700	331,914.00	0.50
3	002285	世联行	95,700	255,519.00	0.38
4	002468	申通快递	18,100	208,693.00	0.31
5	688089	嘉必优	10,200	206,958.00	0.31

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	3,168,471.78	4.73
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	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,168,471.78	4.73

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	019727	23国债24	31,000	3,168,471.78	4.73

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
 本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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，青岛森麒麟轮胎股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到青岛市即墨区消防救援大队的处罚。

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	17,797.67
2	应收证券清算款	701,672.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	199,760.29
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	919,230.30

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

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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

	圆信永丰中证500指数 增强发起A	圆信永丰中证500指数 增强发起C
报告期期初基金份额总额	78,537,584.15	5,000,916.65
报告期期间基金总申购份额	424,457.22	-
减：报告期期间基金总赎回份额	2,374,117.59	-
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	76,587,923.78	5,000,916.65

§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

	圆信永丰中证500指数 增强发起A	圆信永丰中证500指数 增强发起C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,666.83	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
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	10,001,666.83	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	13.06	-

注：报告期末持有的基金份额占比为占A类基金总份额的比例。

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 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	10,001,666.83	12.26%	10,001,666.83	12.26%	不少于3年

基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,001,666.83	12.26%	10,001,666.83	12.26%	不少于3年

§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

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。

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、中国证监会批准圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《圆信永丰中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《圆信永丰中证500指数增强型发起式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。

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

10.3 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10月25日