圆信永丰瑞盈债券型证券投资基金

2026年第3季度报告

2026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:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2026年10月27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 5
§4 管理人报告 7
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 8
4.3 公平交易专项说明 8
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 9
4.5 报告期内基金的业绩表现 9
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 10
§5 投资组合报告 10
5.1 报告期末基金资产组合情况 10
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 10
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 11
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 12
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 13
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 13
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 13
5.11 投资组合报告附注 13
§6 开放式基金份额变动 14
§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 影响投资者决策的其他重要信息 14
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 14
8.2 影响投资者决策的其他重要信息 15
§9 备查文件目录 15
9.1 备查文件目录 15
9.2 存放地点 15
9.3 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月26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2026年7月1日起至2026年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	圆信永丰瑞盈债券
基金主代码	020815
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年04月30日
报告期末基金份额总额	187,373,674.90份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	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，在严格控制风险的前提下，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，适当参与股票市场投资，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。本基金的投资策略包括债券资产配置策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货交易策略。
业绩比较基准	中债总财富（总值）指数收益率×90%+中证800指数收益率×7%+恒生指数收益率×3%（人民币计价）
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其预期收益及预期

	风险水平高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。 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	兴业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	圆信永丰瑞盈债券A	圆信永丰瑞盈债券C	圆信永丰瑞盈债券E
下属分级基金的交易代码	020815	020832	024008
报告期末下属分级基金的份额总额	30,322,557.25份	68,831,615.27份	88,219,502.38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(2026年07月01日 - 2026年09月30日)		
	圆信永丰瑞盈债券A	圆信永丰瑞盈债券C	圆信永丰瑞盈债券E
1.本期已实现收益	-847,140.33	-1,088,891.81	-2,124,258.01
2.本期利润	-3,506,108.40	-4,569,876.31	-6,810,749.93
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0722	-0.0625	-0.0553
4.期末基金资产净值	33,002,400.40	74,480,913.06	95,810,988.57
5.期末基金份额净值	1.0884	1.0821	1.0861

注1：本期指2026年7月1日至2026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

圆信永丰瑞盈债券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	-5.08%	0.49%	0.04%	0.12%	-5.12%	0.37%
过去六个月	0.68%	0.43%	1.75%	0.12%	-1.07%	0.31%
过去一年	1.70%	0.34%	2.35%	0.12%	-0.65%	0.22%
自基金合同生效起至今	8.84%	0.24%	11.38%	0.13%	-2.54%	0.11%

圆信永丰瑞盈债券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	-5.13%	0.49%	0.04%	0.12%	-5.17%	0.37%
过去六个月	0.58%	0.43%	1.75%	0.12%	-1.17%	0.31%
过去一年	1.50%	0.34%	2.35%	0.12%	-0.85%	0.22%
自基金合同生效起至今	8.21%	0.24%	11.38%	0.13%	-3.17%	0.11%

圆信永丰瑞盈债券E净值表现

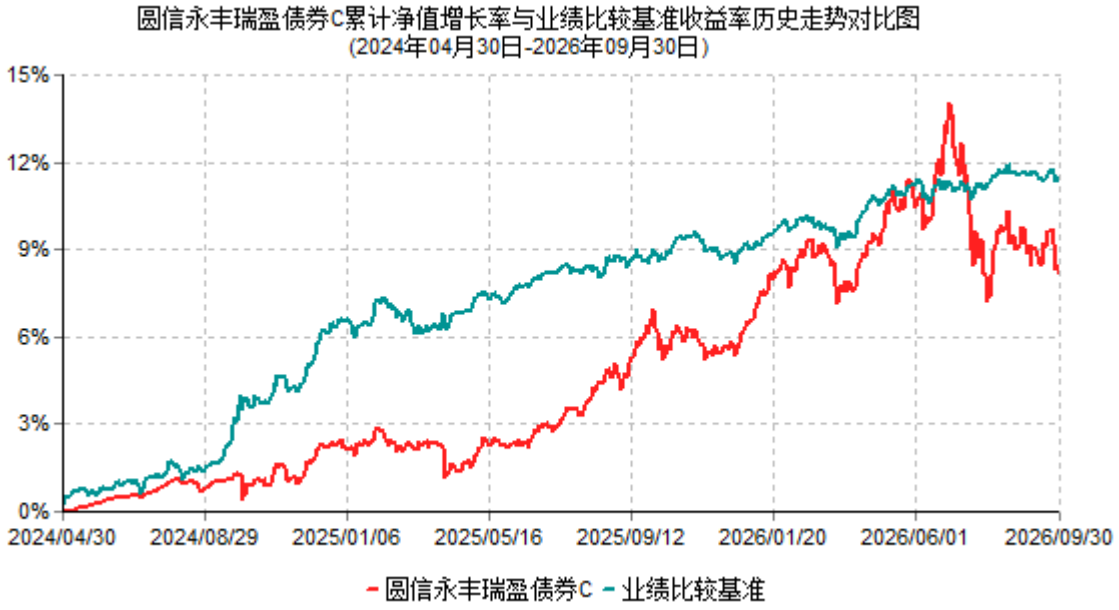
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.10%	0.49%	0.04%	0.12%	-5.14%	0.37%
过去六个月	0.63%	0.43%	1.75%	0.12%	-1.12%	0.31%
过去一年	1.60%	0.34%	2.35%	0.12%	-0.75%	0.22%

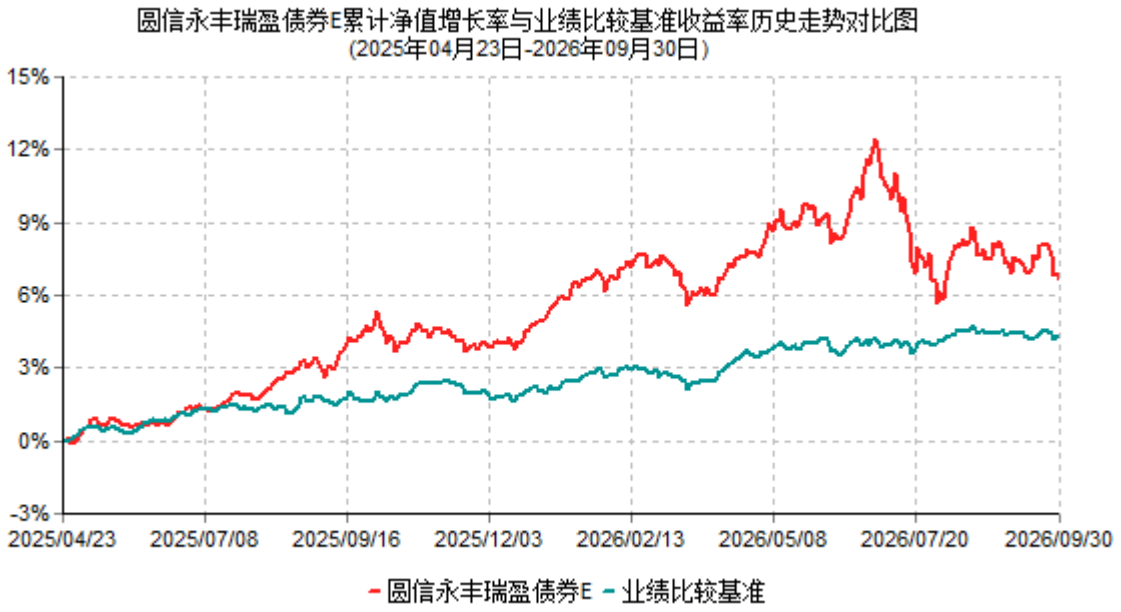
自基金合同生效起至今	6.67%	0.30%	4.23%	0.11%	2.44%	0.19%

注：本基金于 2025 年 4 月 23 日增设 E 类份额，该份额的相关数据和指标按实际存续期计算。

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







注：本基金于 2025 年 04 月 23 日增设 E 类份额，该份额的相关数据和指标按实际存续期计算。

§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		
陈臣	本基金基金经理	2024-04-30	-	16年	上海交通大学工商管理硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司权益研究部副总监（主持工作）。历任易唯思商务咨询有限公司研究部研究助理，永丰金证券（亚洲）有限公司研究部研究员，中国国际金融股份有限公司研究部研究员，圆信永丰基金管理有限公司研究部研究员、总监助理、权益投资部基金经理兼研究部总监助理、研究部副总监（主持工作）。国籍：中国，

					获得的相关业务资格：基金从业资格证。
许燕	本基金基金经理	2024-04-30	-	15年	上海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副总监。历任上海新世纪资信评估投资服务有限公司评级部信用分析师；中证鹏元资信评估股份有限公司评级部信用分析师；圆信永丰基金管理有限公司固收投资部基金经理、总监助理；上海光大证券资产管理有限公司固定收益公募投资部基金经理；圆信永丰基金管理有限公司风险管理部信用风险岗。 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

债券市场方面，2026年三季度利率债整体震荡分化、长端收益率创年内新低。受国内经济修复偏弱、银行间资金面维持宽松、央行流动性呵护及海外利率波动共同影响，收益率曲线呈短端小幅上行、中长端震荡下行的平坦化格局，期限利差压缩至低位。本产品前期聚焦利率债配置，重点布局短期限国开债；伴随产品规模增长，适度增配中期中高等级信用债，兼顾稳定票息与适度资本利得。三季度随着长端收益率下行，组合适当兑现利率债资本利得，逐步优化持仓结构，并将新增配置向中期中高等级信用债倾斜。

权益市场方面，三季度国内权益市场波动明显加大，科技板块在前期快速上涨后出现深度回调，市场呈显著的结构性分化格局。受美联储重启加息、外部流动性扰动及市场风险偏好收缩影响，AI算力硬件等前期热门方向回撤较深；传统周期板块及银行等高股息方向表现相对占优，市场呈现风格再平衡特征。本基金权益配置重心持续聚焦科技产业主线，深耕细分优质赛道，在市场调整阶段适度控制仓位、优化持仓结构，平滑组合波动，把握产业迭代与政策红利机会。

简要展望：债券市场方面，利率中枢偏低，趋势性下行空间有限，期限利差仍存压缩空间。流动性中短端信用债的确定性依然较强，本产品维持票息策略，后续重点关注资金面变化和政策信号，灵活调整持仓结构以提高产品收益率。权益市场短期波动风险仍存，美联储重启加息对全球流动性与估值形成一定扰动，市场不确定性上升，我们将持续锚定产业发展主线，动态优化持仓结构，自下而上优选具备竞争力的标的，积极把握市场波动中涌现的结构性投资机遇。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰瑞盈债券A基金份额净值为1.0884元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.08%，同期业绩比较基准收益率为0.04%；截至报告期末圆信永丰瑞盈债券C基金份额净值为1.0821元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为

-5.13%，同期业绩比较基准收益率为0.04%；截至报告期末圆信永丰瑞盈债券E基金份额净值为1.0861元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.10%，同期业绩比较基准收益率为0.04%。

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	28,349,017.00	11.84
	其中：股票	28,349,017.00	11.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	194,687,626.54	81.30
	其中：债券	194,687,626.54	81.30
	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	9,000,804.84	3.76
	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	4,914,970.98	2.05
8	其他资产	2,523,056.27	1.05
9	合计	239,475,475.63	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	874,500.00	0.43
C	制造业	25,513,767.00	12.55

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	1,960,750.00	0.96
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	28,349,017.00	13.94

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	688777	中控技术	15,000	1,200,750.00	0.59
2	300394	天孚通信	4,500	1,173,465.00	0.58
3	002436	兴森科技	25,000	1,023,500.00	0.50
4	300750	宁德时代	3,500	1,018,885.00	0.50
5	000962	东方钽业	18,000	976,860.00	0.48

6	688677	海泰新光	12,000	912,720.00	0.45
7	600183	生益科技	7,000	909,720.00	0.45
8	301392	汇成真空	6,000	889,320.00	0.44
9	301018	申菱环境	10,000	883,100.00	0.43
10	688362	甬矽电子	16,000	865,440.00	0.43

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	17,317,597.51	8.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,321,361.09	7.54
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	126,807,676.71	62.38
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	35,240,991.23	17.33
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	194,687,626.54	95.77

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	019792	25国债19	155,000	15,707,245.62	7.73
2	524921	26宝安投资01	150,000	15,028,282.19	7.39
3	148595	24重发01	100,000	10,451,336.99	5.14
4	148667	24榕水02	100,000	10,383,139.18	5.11
5	2220007	22厦门国际银行永续债01	100,000	10,330,550.68	5.08

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

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

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，厦门国际银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行厦门市分行的处罚。

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约定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	57,993.39
2	应收证券清算款	2,465,042.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,523,056.27

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

	圆信永丰瑞盈债券A	圆信永丰瑞盈债券C	圆信永丰瑞盈债券E
报告期期初基金份额总额	66,961,849.25	93,076,381.23	125,772,249.66
报告期期间基金总申购份额	1,550,755.38	4,814,651.83	6,366.11
减：报告期期间基金总赎回份额	38,190,047.38	29,059,417.79	37,559,113.39
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	30,322,557.25	68,831,615.27	88,219,502.38

§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

投资者类	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

别							
机构	1	20260701-20260930	88,214,537.76	-	-	88,214,537.76	47.08%
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瑞盈债券型证券投资基金设立的文件；

2、《圆信永丰瑞盈债券型证券投资基金基金合同》；

3、《圆信永丰瑞盈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

2026年10月27日