

汇泉臻心致远混合型证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人:汇泉基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	汇泉臻心致远混合
基金主代码	013051
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 11 月 02 日
报告期末基金份额总额	386,116,263.38 份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和投资管理，追求超越基金业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括： 1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、国债期货投资策略；8、参与融资业务的投资策略
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债综合全价（总值）指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。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	汇泉基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	汇泉臻心致远混合 A	汇泉臻心致远混合 C
下属分级基金的交易代码	013051	013052
报告期末下属分级基金的份额总额	228,633,568.12 份	157,482,695.26 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）	
	汇泉臻心致远混合 A	汇泉臻心致远混合 C
1. 本期已实现收益	-13,322,616.44	-8,976,328.72
2. 本期利润	6,883,852.66	4,717,356.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0290	0.0292
4. 期末基金资产净值	113,369,481.70	77,183,420.78
5. 期末基金份额净值	0.4959	0.4901

注：1、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，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

###### 汇泉臻心致远混合 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	6.94%	1.24%	11.58%	1.12%	-4.64%	0.12%
过去六个月	-0.12%	1.25%	11.64%	0.91%	-11.76%	0.34%
过去一年	-15.63%	1.55%	7.55%	0.83%	-23.18%	0.72%
自基金合同生效起至今	-50.41%	1.33%	-10.02%	0.83%	-40.39%	0.50%

###### 汇泉臻心致远混合 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	6.82%	1.24%	11.58%	1.12%	-4.76%	0.12%
过去六个月	-0.33%	1.25%	11.64%	0.91%	-11.97%	0.34%
过去一年	-15.98%	1.55%	7.55%	0.83%	-23.53%	0.72%
自基金合同生效起至今	-50.99%	1.33%	-10.02%	0.83%	-40.97%	0.50%

##### 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

汇泉臻心致远混合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11月02日-2024年09月30日)



汇泉臻心致远混合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11月02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		
梁永强	公司总经理、基金经理、投资经理	2021-11-02	-	22 年	中国国籍，博士研究生，具有基金从业资格。曾任华商基金管理有限公司投资管理部副总经理、量化投资部总经理、公司副总经理、公司总经理。现任汇泉基金管理有限公司总经理、基金经理兼任投资经理。
周晓东	基金经理、研究部总监	2023-03-13	2024-09-25	10 年	中国国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华创证券研究所电力设备新能源、机械行业研究员，新华基金管理股份有限公司机械军工行业研究员、制造组组长、投资经理，汇泉基金管理有限公司基金经理助理、投资经理、研究部副总监、研究部总监、基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
梁永强	公募基金	3	1,229,038,631.48	2021-07-20
	私募资产管理计划	1	45,781,540.48	2022-07-27
	其他组合	-	-	-
	合计	4	1,274,820,171.96	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

#### 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》等有关法律法规及基金合同、基金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，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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，未出现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的 5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

从今年实体经济来看，出口相对较好，消费和投资依然处于调整阶段；从政策方面来看，货币和财政政策都相对稳健，“国九条”发布以后对资本市场形成一系列配套政策和制度，这些制度的实施从市场生态方面形成长远的影响，短期对市场风格影响比较大。高股息资产持续表现比较好，其他类资产相对较弱，尤其是科技成长方面波动更大。在目前市场位置，整体市场还处于低位，依然是对未来好的方向和公司持续坚定布局的时候，在经济结构调整转型中找到持续受益者和社会资源

不断涌入的方向。

九月份市场变化比较大，9 月 24 日国新办央行发布会有可能会成为市场转折点，监管层对于经济和市场的态度和实际措施都看到了明显变化，叠加随后 9 月 26 日政治局会议关于经济整体发展态势和未来政策重点的定调，整个市场基本上大概率会逐步走出相对低迷的阶段，未来从仓位和行业配置方面都可以更积极一些。

在整体市场估值提升过程中，仓位的影响是最大的，同时也会逐步进行结构上的调整。市场稳定以后，从资本市场和实体互动的程度来看，新质生产力为代表的科技方向是政府政策和社会各类资源不断涌入的方向，因此市场对这些方向的定价将更有弹性。前期配置较多的红利资产依然是市场稳步向好的基础，也是长期机构配置的方向。目前组合重点配置的方向除了低估值红利资产外，对电力设备、消费、金融、电子、医药行业的龙头公司逐步增加关注，另外对半导体、机器人、卫星互联网、军工等成长方向的优质公司也逐步增加了配置。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇泉臻心致远混合 A 基金份额净值为 0.4959 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.94%，同期业绩比较基准收益率为 11.58%；截至报告期末汇泉臻心致远混合 C 基金份额净值为 0.4901 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.82%，同期业绩比较基准收益率为 11.58%。

#### 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，本基金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	158,276,175.16	82.78
	其中：股票	158,276,175.16	82.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	3,000,030.00	1.57

	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	27,539,962.48	14.40
8	其他资产	2,390,888.47	1.25
9	合计	191,207,056.11	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 3,502,552.36 元，占净值比例 1.84%。

## 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	2,015,442.00	1.06
B	采矿业	8,427,801.00	4.42
C	制造业	110,760,128.80	58.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,155,637.00	2.71
E	建筑业	2,459,354.00	1.29
F	批发和零售业	1,943,726.00	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	3,746,175.00	1.97
H	住宿和餐饮业	186,862.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,085,355.00	3.19
J	金融业	7,799,084.00	4.09
K	房地产业	1,332,477.00	0.70
L	租赁和商务服务业	1,793,119.00	0.94
M	科学研究和技术服务业	1,678,969.00	0.88
N	水利、环境和公共设施管理业	1,635.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	210,163.00	0.11
Q	卫生和社会工作	389,700.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	787,995.00	0.41
S	综合	-	-
	合计	154,773,622.80	81.22

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
能源	3,502,552.36	1.84
合计	3,502,552.36	1.84

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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	300750	宁德时代	17,900	4,508,831.00	2.37
2	600519	贵州茅台	2,300	4,020,400.00	2.11

3	00883	中国海洋石油	200,000	3,502,552.36	1.84
3	600938	中国海油	7,900	237,395.00	0.12
4	002475	立讯精密	72,200	3,137,812.00	1.65
5	000858	五粮液	18,700	3,038,937.00	1.59
6	000333	美的集团	39,000	2,966,340.00	1.56
7	300760	迈瑞医疗	7,600	2,226,800.00	1.17
8	000568	泸州老窖	13,300	1,991,010.00	1.04
9	002371	北方华创	5,300	1,939,694.00	1.02
10	300308	中际旭创	11,300	1,749,918.00	0.92

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2503	沪深 300 股指期货 2503 合约	15	18,605,700.00	3,658,500.00	-
公允价值变动总额合计(元)					3,658,500.00
股指期货投资本期收益(元)					-482,145.77
股指期货投资本期公允价值变动(元)					3,658,500.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。本基金主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响较小，符合本基金合同约定的投资政策和投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

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受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期末未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。

**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	2,232,684.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	97,323.38
4	应收利息	-
5	应收申购款	60,881.09
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,390,888.47

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位：份

	汇泉臻心致远混合 A	汇泉臻心致远混合 C
报告期期初基金份额总额	248,475,883.56	165,554,728.14
报告期期间基金总申购份额	233,870.60	1,009,080.78
减：报告期期间基金总赎回份额	20,076,186.04	9,081,113.66
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	228,633,568.12	157,482,695.26

**§ 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**

无。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 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、中国证监会批准汇泉臻心致远混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《汇泉臻心致远混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇泉臻心致远混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇泉臻心致远混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 9.2 存放地点

北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层。

### 9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.springsfund.com](http://www.springsfund.com)）查阅。

汇泉基金管理有限公司

二〇二四年十月二十五日