

京管泰富优势企业混合型发起式证券投资
基金
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：北京京管泰富基金管理有限责任公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 21 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	京管泰富优势混合	
基金主代码	007303	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2023 年 11 月 17 日	
报告期末基金份额总额	209,753,173.59 份	
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险和保持资产流动性的前提下，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	本基金的投资策略包括大类资产配置策略，股票投资策略，债券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，资产支持证券投资策略、参与融资业务的策略。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×65%+中债新综合全价（总值）指数收益率×35%	
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	北京京管泰富基金管理有限责任公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	京管泰富优势混合 A	京管泰富优势混合 C
下属分级基金的交易代码	007303	007304
报告期末下属分级基金的份额总额	203,023,189.89 份	6,729,983.70 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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	京管泰富优势混合 A	京管泰富优势混合 C
1. 本期已实现收益	-14,630,300.03	-512,851.46
2. 本期利润	22,426,005.50	727,956.85
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1102	0.1044
4. 期末基金资产净值	216,229,309.10	7,142,680.86
5. 期末基金份额净值	1.0650	1.0613

注：1. 上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

京管泰富优势混合 A

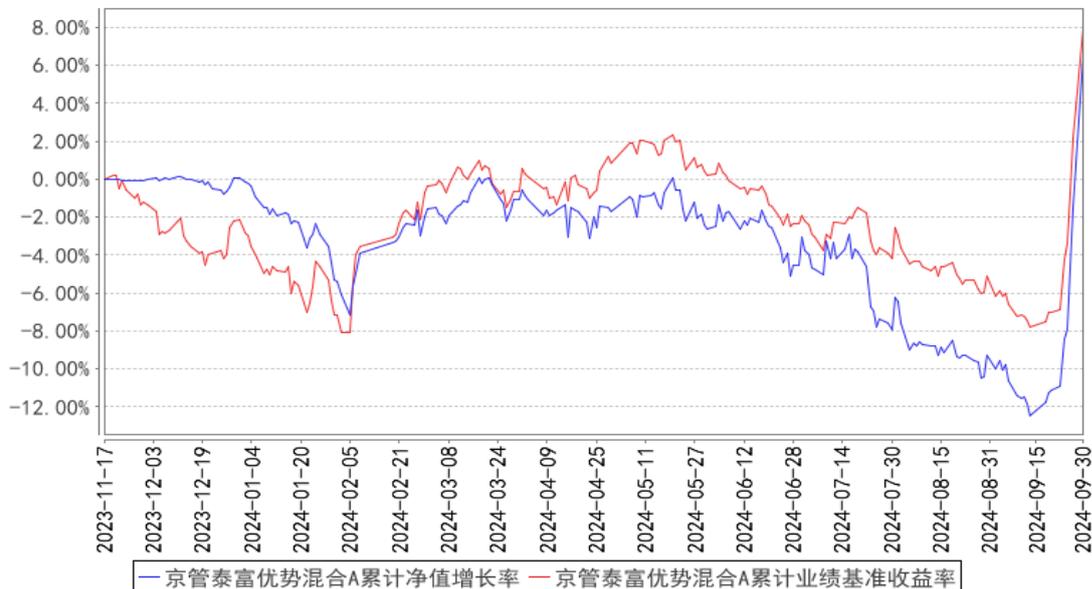
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.59%	1.45%	10.52%	1.06%	1.07%	0.39%
过去六个月	7.67%	1.15%	8.61%	0.85%	-0.94%	0.30%
自基金合同生效起至今	6.50%	0.93%	7.94%	0.79%	-1.44%	0.14%

京管泰富优势混合 C

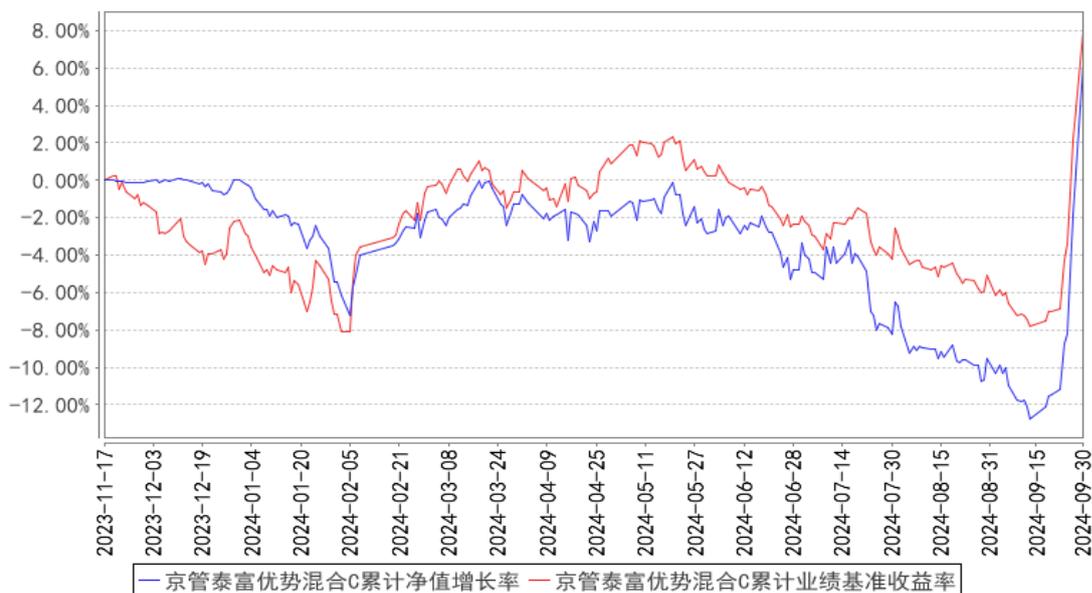
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.48%	1.45%	10.52%	1.06%	0.96%	0.39%
过去六个月	7.46%	1.15%	8.61%	0.85%	-1.15%	0.30%
自基金合同生效起至今	6.13%	0.93%	7.94%	0.79%	-1.81%	0.14%

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

京管泰富优势混合A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



京管泰富优势混合C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



注：1. 本基金基金合同的生效日为 2023 年 11 月 17 日。按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例均符合合同约定；

2. 本基金业绩比较基准为中证 800 指数收益率×65%+中债新综合全价（总值）指数收益率×35%。

§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		
王萍萍	本基金基金经理	2023 年 11 月 17 日	-	11 年	王萍萍，中央财经大学经济学硕士，持有基金从业资格证。2018 年 10 月加入公司，曾任公司投资经理。2023 年 11 月 17 日至今，任京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金的基金经理。曾在华商基金管理有限公司担任投资经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准，对于首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日期。证券从业年限以从事证券、基金业务相关工作的时间为计算标准。

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

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》和相关法律法规，以及《基金合同》、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，在严控风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，本基金的投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，没有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

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《公平交易管理办法》《异常交易监控管理办法》，对研究、决策、交易执行等各个环节做出了明确具体的规定并严格执行。在保证本基金管理人管理的所有投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议、实施投资决策、交易执行等方面得到公平对待，并对买卖债券、股票的价格和市场价格差距较大，可能存在利益输送、操纵股价等违法违规情况进行监控。

本报告期内，公平交易制度执行情况良好，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与交易所公开竞价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 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度股票市场走出先抑后扬的反转行情。三季度 A 股市场面临情绪偏弱、宏观经济数据走弱的局面，但在九月下旬重磅政策的密集刺激下，大中小盘各类指数强力反弹，9 月份最后几个交易日，A 股市场上演了连续上涨的逼空走势。宏观政策超预期是驱动市场放量大涨的核心原因，后续政策的空间与力度决定了未来行情的高度。海外方面美国进入降息周期，美债收益率下行，A 股外部流动性改善。上市公司 Q3 盈利侧虽然仍有一定压力，但政策端已在提前发力，全 A 业绩有望企稳、逐步回升。随着国内一揽子政策落地、海外流动性宽松带动经济复苏，投资者信心将逐步恢复，中长期趋势上可以对市场乐观起来。本基金三季度仓位有所增加，目前持仓较为均衡。主要持有行业包括电子、机械、计算机、公用事业、有色、交运等，后续将延续均衡的配置思路。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类份额净值为 1.0650 元，报告期内基金份额净值增长率为 11.59%；截至本报告期末本基金 C 类份额净值为 1.0613 元，报告期内基金份额净值增长率为 11.48%；同期业绩比较基准收益率为 10.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内未出现基金持有人数或基金资产净值预警情形。

§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	205,857,796.83	88.52
	其中：股票	205,857,796.83	88.52
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	-	-
	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	21,412,656.09	9.21
8	其他资产	5,284,948.00	2.27
9	合计	232,555,400.92	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	13,108,800.00	5.87
C	制造业	97,941,740.94	43.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,069,620.00	4.51
E	建筑业	1,236,000.00	0.55
F	批发和零售业	7,387,200.00	3.31
G	交通运输、仓储和邮政业	18,644,280.00	8.35
H	住宿和餐饮业	1,566,500.00	0.70
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,865,000.00	15.16
J	金融业	9,336,400.00	4.18
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,355,875.34	2.85
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,308,780.55	2.38
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	1,037,600.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	205,857,796.83	92.16

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 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

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	600031	三一重工	570,000	10,761,600.00	4.82
2	000598	兴蓉环境	1,387,000	10,069,620.00	4.51
3	688111	金山办公	32,000	8,524,800.00	3.82
4	300750	宁德时代	33,000	8,312,370.00	3.72
5	001872	招商港口	360,000	8,168,400.00	3.66
6	000425	徐工机械	1,040,000	8,080,800.00	3.62
7	000333	美的集团	104,000	7,910,240.00	3.54
8	000034	神州数码	240,000	7,387,200.00	3.31

9	002352	顺丰控股	156,000	7,016,880.00	3.14
10	603529	爱玛科技	178,901	6,708,787.50	3.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

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进行国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

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是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期内投资的前十名股票未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	258,023.32
2	应收证券清算款	4,981,992.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	44,932.60
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,284,948.00

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

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

项目	京管泰富优势混合 A	京管泰富优势混合 C
报告期期初基金份额总额	203,736,500.50	7,656,257.25
报告期期间基金总申购份额	82,472.76	10,589.20
减：报告期期间基金总赎回份额	795,783.37	936,862.75
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	203,023,189.89	6,729,983.70

§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

本报告期内管理人未运用固有资金投资本基金。

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	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	100,088,889.78	47.7175	100,088,889.78	47.7175	不少于三年
其他	-	-	-	-	-
合计	100,088,889.78	47.7175	100,088,889.78	47.7175	-

§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

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	20240701-20240930	100,088,889.78	-	-	100,088,889.78	47.7175
	2	20240701-20240930	100,061,111.72	-	-	100,061,111.72	47.7042
产品特有风险							
<p>1. 报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险包括但不限于：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回、暂停赎回或延期办理赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；</p> <p>2. 《基金合同》生效满三年后继续存续的，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200</p>							

人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，本基金将根据《基金合同》的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会。投资人将面临基金合同可能终止的不确定性风险；

3. 本基金为发起式基金，本基金发起资金提供方对本基金的认购，并不代表对本基金的风险或收益的任何判断、预测、推荐和保证，发起资金也并不用于对投资者投资亏损的补偿，投资者及发起资金提供方均自行承担投资风险。本基金发起资金认购的本基金份额持有期限自基金合同生效日起满 3 年后，发起资金提供方将根据自身情况决定是否继续持有，届时发起资金提供方有可能赎回认购的基金份额。另外，基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止。因此，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

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. 中国证监会准予京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；
2. 《京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金基金合同》；
3. 《京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金托管协议》；
4. 《京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
5. 基金管理人业务资格批准文件、营业执照；
6. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

10.2 存放地点

基金管理人地址：北京市西城区西直门南小街国英园 9 号楼。

10.3 查阅方式

1. 投资者可登录基金管理人官方网站（www.cdbsfund.com）或在营业时间内到北京京管泰富基金管理有限责任公司免费查阅上述文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

2. 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人北京京管泰富基金管理有限责任公司。客户服务中心电话：400-898-3299。

北京京管泰富基金管理有限责任公司

2024 年 10 月 25 日