

---

**圆信永丰沅泰混合型证券投资基金**

**2020 年第 3 季度报告**

**2020 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:2020 年 10 月 28 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.....	3
3.1 主要财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	6
4.3 公平交易专项说明.....	6
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析.....	7
4.5 报告期内基金的业绩表现.....	7
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	7
§5 投资组合报告.....	7
5.1 报告期末基金资产组合情况.....	7
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	8
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.....	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	9
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.....	10
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.....	10
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.....	10
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.....	10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	11
5.11 投资组合报告附注.....	11
§6 开放式基金份额变动.....	12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	12
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	12
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	13
§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	13
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.....	13
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	13
§9 备查文件目录.....	13
9.1 备查文件目录.....	13
9.2 存放地点.....	13
9.3 查阅方式.....	13

## § 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规定，于2020年10月27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2020年7月1日起至2020年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	圆信永丰沣泰
基金主代码	009054
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年04月29日
报告期末基金份额总额	280,169,965.68份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金通过对国家宏观经济政策的深入分析，在动态跟踪财政政策、货币政策的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响和预期收益风险，评估股票、债券等大类资产的估值水平和投资价值，确定投资组合的资产配置比例，并适时进行调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。
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

## § 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（2020年07月01日 - 2020年09月30日）
1. 本期已实现收益	7,718,914.77
2. 本期利润	6,401,577.12
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0267
4. 期末基金资产净值	286,585,104.08
5. 期末基金份额净值	1.0229

注1：本期指2020年7月1日至2020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

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	0.81%	0.99%	2.37%	0.32%	-1.56%	0.67%
自基金合同生效起至今	2.29%	0.79%	3.92%	0.27%	-1.63%	0.52%

#### 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

圆信永丰沔泰混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年04月29日-2020年09月30日)



注：自基金合同生效后，截止报告期末，本基金成立不满一年；本基金未完成建仓。

## § 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		
范习辉	本基金基金经理	2020-04-29	-	17年	华中科技大学电力系统及其自动化博士，现任圆信永丰基金管理有限公司权益投资部总监助理。历任兴业证券研究发展中心研究员、平安资产管理有限责任公司股票投资部投资经理、富善投资有限公司股票投资部投资经理。 国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格

					证。
林铮	本基金基金经理	2020-04-29	-	11年	厦门大学经济学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司固收投资部副总监。历任厦门国贸集团投资研究员、国贸期货宏观金融期货研究员、海通期货股指期货分析师、圆信永丰基金管理有限公司专户投资部副总监。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合规守信情况的说明

报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。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、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

2020年三季度，债券市场整体收益率持续走高，债券收益率整体已经回到去年四季度高位；但由于国内疫情控制明显好于海外，相对积极的政策增强经济复苏预期，加上加大直接融资，发展权益市场的政策指引，这些都为A股市场创造了较好的宏观环境，三季度A股市场整体具有明显赚钱效应。转债市场受债券下跌带来的估值压缩和股票市场上上涨推动的双向影响，三季度整体具有一定收益，但个券分化仍然较大。

基于对债券市场维持谨慎预期，在报告期内，组合债券主要仍以短久期高流动性资产滚动配置为主，转债配置思路主要是以高性价比个券阶段配置为主。同时基于对权益市场整体看好的观点，组合在股票方面配置相对积极，主要配置在A股景气周期向上行业的核心资产上。

权益方面，进入三季度，国内新冠疫情得到有效控制，经济活力恢复明显，对应的市场风格也出现变换，顺周期低估值特征相对占优。本基金权益部分基于中期景气角度，除了继续持有前期看好的价值成长类个股，持仓结构也进行了一定的调整，使其相对趋于均衡。

展望四季度，短期基本面的变化和流动性状况仍然更利于权益市场表现，资产配置上，固定收益组合将维持较为谨慎的配置思维，控制债券组合久期并挑选具有性价比个券进行配置，通过对转债精选配置，从而在控制组合收益波动基础上，提升组合收益收益；权益方面，我们认为市场仍处于波动状态，投资机会继续相对趋于均衡。但新能源，电动车，消费电子，周期成长以及部分金融股的景气前景更加值得看好。操作上，行业均衡，个股集中，减少净值波动性，争取稳步持续提升。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰沣泰基金份额净值为1.0229元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.81%，同期业绩比较基准收益率为2.37%。

#### 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	107,793,373.37	34.03
	其中：股票	107,793,373.37	34.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	141,718,366.32	44.73
	其中：债券	141,718,366.32	44.73
	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	20,006,230.01	6.32
	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	45,681,431.71	14.42
8	其他资产	1,604,145.87	0.51
9	合计	316,803,547.28	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	-	-
C	制造业	87,380,385.35	30.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	16,793.79	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	9,676.49	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,111.97	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-



L	租赁和商务服务业	11,769,448.48	4.11
M	科学研究和技术服务业	1,197,700.00	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	26,878.17	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,327,350.00	2.56
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	107,793,373.37	37.61

### 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	002007	华兰生物	215,600	12,287,044.00	4.29
2	601888	中国中免	52,792	11,769,448.48	4.11
3	002812	恩捷股份	98,600	9,018,942.00	3.15
4	600745	闻泰科技	73,300	8,565,838.00	2.99
5	000661	长春高新	20,000	7,392,800.00	2.58
6	300015	爱尔眼科	142,500	7,327,350.00	2.56
7	300463	迈克生物	136,100	7,210,578.00	2.52
8	300751	迈为股份	20,500	6,945,195.00	2.42
9	600438	通威股份	232,300	6,174,534.00	2.15
10	603686	龙马环卫	275,671	6,161,246.85	2.15

### 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	4,499,496.00	1.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,100,500.00	3.18

	其中：政策性金融债	9,100,500.00	3.18
4	企业债券	40,162,000.00	14.01
5	企业短期融资券	30,025,000.00	10.48
6	中期票据	10,087,000.00	3.52
7	可转债（可交换债）	47,844,370.32	16.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	141,718,366.32	49.45

### 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	155216	19漳九01	100,000	10,102,000.00	3.52
2	101553034	15象屿MTN002	100,000	10,087,000.00	3.52
3	041900383	19国网租赁CP001	100,000	10,062,000.00	3.51
4	136236	16复药01	100,000	10,037,000.00	3.50
5	136393	16武金02	100,000	10,018,000.00	3.50

### 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

根据基金合同规定，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

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货投资。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 通过查阅中国证监会、中国银保监会网站公开目录“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，报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有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	123,598.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,480,436.62
5	应收申购款	110.87
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,604,145.87

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	6,597,920.00	2.30
2	110059	浦发转债	4,501,640.00	1.57
3	110056	亨通转债	2,758,500.00	0.96
4	128066	亚泰转债	1,809,216.00	0.63
5	132018	G三峡EB1	1,743,000.00	0.61
6	128102	海大转债	1,587,801.60	0.55
7	127013	创维转债	1,565,316.64	0.55
8	113032	桐20转债	1,561,170.00	0.54

9	113534	鼎胜转债	1,418,690.00	0.50
10	128081	海亮转债	1,040,391.88	0.36
11	113525	台华转债	721,167.30	0.25
12	110051	中天转债	717,720.00	0.25
13	113029	明阳转债	672,350.00	0.23
14	110034	九州转债	399,849.30	0.14
15	127005	长证转债	388,080.00	0.14
16	113537	文灿转债	326,638.00	0.11
17	128101	联创转债	218,740.00	0.08
18	113021	中信转债	209,980.00	0.07
19	113571	博特转债	145,500.00	0.05
20	128075	远东转债	129,490.00	0.05
21	113020	桐昆转债	127,490.00	0.04
22	128071	合兴转债	126,950.00	0.04
23	128058	拓邦转债	84,024.60	0.03
24	110038	济川转债	55,970.00	0.02

#### 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未存在流通受限。

#### 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

报告期期初基金份额总额	293,624,793.95
报告期期间基金总申购份额	119,392,902.28
减：报告期期间基金总赎回份额	132,847,730.55
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	280,169,965.68

### § 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，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	20200909-20200930	0.00	97,946,177.49	0.00	97,946,177.49	34.96%
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沅泰混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《圆信永丰沅泰混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《圆信永丰沅泰混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、报告期内在指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

2020年10月28日