
圆信永丰优选价值混合型证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2021 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	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合规守信情况的说明	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 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	10
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	10
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	11
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	11
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	11
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	11
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	11
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	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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021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2021年7月1日起至2021年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	圆信永丰优选价值
基金主代码	008311
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年05月18日
报告期末基金份额总额	240,143,484.29份
投资目标	在严格控制风险的基础上，本基金充分挖掘各类金融工具的潜在投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
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。资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水

	平高于债券型基金、货币市场基金，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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	圆信永丰优选价值A	圆信永丰优选价值C
下属分级基金的交易代码	008311	008312
报告期末下属分级基金的份额总额	230,872,279.36份	9,271,204.93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(2021年07月01日 - 2021年09月30日)	
	圆信永丰优选价值A	圆信永丰优选价值C
1. 本期已实现收益	13,651,735.15	594,112.09
2. 本期利润	-38,985,735.29	-1,745,513.37
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1577	-0.1601
4. 期末基金资产净值	360,512,620.85	14,236,341.95
5. 期末基金份额净值	1.5615	1.5355

注1：本期指2021年7月1日至2021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

圆信永丰优选价值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	-8.99%	1.47%	-4.33%	0.84%	-4.66%	0.63%

过去六个月	4.75%	1.37%	-1.70%	0.77%	6.45%	0.60%
过去一年	28.14%	1.45%	5.72%	0.85%	22.42%	0.60%
自基金合同生效起至今	56.15%	1.39%	18.45%	0.89%	37.70%	0.50%

圆信永丰优选价值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	-9.17%	1.47%	-4.33%	0.84%	-4.84%	0.63%
过去六个月	4.31%	1.37%	-1.70%	0.77%	6.01%	0.60%
过去一年	26.92%	1.45%	5.72%	0.85%	21.20%	0.60%
自基金合同生效起至今	53.55%	1.39%	18.45%	0.89%	35.10%	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

圆信永丰优选价值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
(2020年05月18日-2021年09月30日)



注：自基金合同生效后，截止报告期末，本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

圆信永丰优选价值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
(2020年05月18日-2021年09月30日)



注：自基金合同生效后，截止报告期末，本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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	2020-05-18	-	11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投资部基金经理兼研究部总监助理。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。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

2021年三季度，上证综指下跌0.6%，深证成指下跌5.62%，创业板指下跌6.69%。主要指数有所调整，板块分化加剧，煤炭、公共事业、有色、钢铁、化工等行业指数涨幅较大，医药、休闲服务、食品饮料等行业表现较差。

本基金于三季度延续了此前的投资策略。报告期内基金始终维持了较高的股票仓位，行业配置均衡，具体来看，基金超配了新能源、食品饮料、医药、建材、机械、化工等行业。报告期内，国内股票市场风格变化较为极致，传统周期行业指数和个股实现了非常大的涨幅，本基金在报告期内“不畏浮云遮望眼”，保持战略定力，坚持致力于寻找具有远大前程的优秀企业，坚持做正确的事、擅长的事，坚持赚取企业长期成长的复利、避免零和博弈。基于我们的投资框架，报告期内本基金对部分持仓及个股仓位进行了调整，以期提高我们的长期预期收益水平，整体持仓结构稳定。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰优选价值A基金份额净值为1.5615元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.99%，同期业绩比较基准收益率为-4.33%；截至报告期末圆信永丰优选价值C基金份额净值为1.5355元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.17%，同期业绩比较基准收益率为-4.33%。

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	353,870,074.03	93.87
	其中：股票	353,870,074.03	93.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,292,034.60	5.12
	其中：债券	19,292,034.60	5.12
	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	2,375,073.35	0.63
8	其他资产	1,458,538.80	0.39
9	合计	376,995,720.78	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	18,077.03	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	302,701,297.43	80.77
D	电力、热力、燃气及水生 生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,151.69	0.01
F	批发和零售业	71,449.52	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	14,544,003.00	3.88
H	住宿和餐饮业	3,898.08	0.00
I	信息传输、软件和信息技 术服务业	83,448.36	0.02
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	36,374,317.84	9.71
N	水利、环境和公共设施管理业	41,633.46	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	11,797.62	0.00
S	综合	-	-
	合计	353,870,074.03	94.43

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	600519	贵州茅台	16,900	30,927,000.00	8.25
2	002311	海大集团	436,287	29,405,743.80	7.85
3	300750	宁德时代	55,087	28,960,888.51	7.73
4	600309	万华化学	251,175	26,812,931.25	7.15
5	603259	药明康德	169,390	25,882,792.00	6.91
6	002791	坚朗五金	177,883	24,435,787.71	6.52
7	300470	中密控股	575,200	21,391,688.00	5.71
8	601012	隆基股份	227,680	18,779,046.40	5.01
9	000568	泸州老窖	62,300	13,804,434.00	3.68
10	600176	中国巨石	761,300	13,383,654.00	3.57

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	8,786,901.10	2.34

2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,006,000.00	2.67
	其中：政策性金融债	10,006,000.00	2.67
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）	499,133.50	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,292,034.60	5.15

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	210206	21国开06	100,000	10,006,000.00	2.67
2	019654	21国债06	87,790	8,786,901.10	2.34
3	127045	牧原转债	2,825	376,233.50	0.10
4	127046	百润转债	1,229	122,900.00	0.03

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

根据基金合同约定，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	61,568.33
2	应收证券清算款	1,163,997.16
3	应收股利	-
4	应收利息	204,598.64
5	应收申购款	28,374.67
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,458,538.80

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

	圆信永丰优选价值A	圆信永丰优选价值C
报告期期初基金份额总额	265,084,663.63	13,551,948.00
报告期期间基金总申购份额	7,293,166.71	-
减：报告期期间基金总赎回份额	41,505,550.98	4,280,743.07
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	230,872,279.36	9,271,204.93

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

§ 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	20210831-20210930	49,999,000.00	0.00	0.00	49,999,000.00	20.82%
	2	20210831-20210930	49,999,000.00	0.00	0.00	49,999,000.00	20.82%
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优选价值混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《圆信永丰圆信永丰优选价值混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《圆信永丰圆信永丰优选价值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

2021年10月27日