圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:2019年07月19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。基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	圆信永丰优享生活
基金主代码	004958
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年08月30日
报告期末基金份额总额	419,215,887.26份
投资目标	本基金重点关注国家健康生活产品发展过程中带来的投资机会,综合运用多种投资策略,精选健康生活产业及相关产业中的优质企业进行投资,在充分控制风险的前提下,灵活配置股票、债券等大类资产,谋求基金资产的长期稳健理值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上,自上而下调整基金大类资产配置和股票行业配置策略,确定债券组合久期和债券类别配置;在严谨深入的股票和债券研究分析基础上,自下而上精选个券。其中,本基金股票投资重点关注于有利引领和提升居民生活水平的上市公司,把握经济增长过程中居民需求升级蕴含的投资机会。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×35%
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

§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(2019年04月01日 - 2019年06月30日)
1.本期已实现收益	27,512,088.99
2.本期利润	-11,024,197.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0255
4.期末基金资产净值	402,398,966.04
5.期末基金份额净值	0.9599

注1:本期指2019年4月1日至2019年6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。

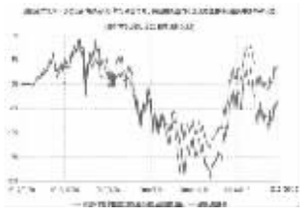
注2:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	-2.96%	1.44%	-0.37%	1.00%	-2.58%	0.44%

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



§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		
范妍	本基金基金经理	2017-08-30	-	11年	复旦大学管理学硕士,现任圆信永丰基金管理有限公司权益投资部总监。历任兴业证券研究中心助理策略分析师、安信证券研究中心高级策略分析师、工银瑞信基金策略研究员、圆信永丰基金管理有限公司权益投资部副总监。国籍:中国,获得的相关业务资格:基金从业资格证。
肖世源	本基金基金经理	2017-09-14	-	8年	复旦大学中西医结合临床硕士,现任圆信永丰基金管理有限公司权益投资部基金经理。历任上海合勤投资管理合伙企业(有限合伙)投研部研究员,上海呈瑞投资管理有限公司投研部研究员,圆信永丰基金管理有限公司研究部研究员。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、特定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

4月份,国债收益率上行,北上净流入资金出现负增长,这和一季度北上资金推动,国内融资加杠杆带来的行情出现了偏离。相应地我们调整了仓位,对市场的判断由乐观转向中性。

由于宏观经济环境偏弱,各个行业的盈利能力受到不同程度的影响,我们自下而上,平衡估值和业绩增长的不确定性,选择了一批长期增长前景仍然稳定的个股。对于投资者仓位比较集中的食品饮料行业和预期乐观的周期行业(我们称之为3月份"周期幻觉"),我们进行了减仓。

长期看,在大类资产的比较中,股票类资产的估值仍然处于历史的低位,债券、地产、理财、其它国家股市等资产类别的预期回报率在下降,仍有资产配置的压力。因此虽然宏观经济周期并不乐观,但是我们不排除资金面出现类似一季度的波动。

政策的主基调是不大水漫灌、支持实体经济发展、促经济转型、提高经济增长质量,与之相对应,直接融资的重要性提升,因此我们的配置上以经济转型的方向为主要的配置基础,部分低估值的行业为配置底仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰优享生活基金份额净值为0.9599元,本报告期内,基金份额净值增长率为-2.95%,同期业绩比较基准收益率为-0.37%。

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	329,200,040.98	81.38
	其中:股票	329,200,040.98	81.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,005,000.00	4.95
	其中:债券	20,005,000.00	4.95
	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	30,000,000.00	7.42
	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	23,727,289.39	5.87
8	其他资产	1,565,452.04	0.39
9	合计	404,497,782.41	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	7,860,091.52	1.95
B	采矿业	9,827,629.35	2.44
C	制造业	237,993,963.66	59.14
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	9,023,427.39	2.24
G	交通运输、仓储和邮政业	24,407,500.00	6.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,428,434.76	2.34
J	金融业	4,795,869.94	1.19
K	房地产业	13,905,000.00	3.46
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	60,200.00	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	6,060,817.76	1.51
R	文化、体育和娱乐业	5,837,106.60	1.45
S	综合	-	-
	合计	329,200,040.98	81.81

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	000651	格力电器	415,700	22,863,500.00	5.68
2	002179	中航光电	540,049	18,070,039.54	4.49
3	002511	中顺洁柔	1,300,000	15,964,000.00	3.97
4	600031	三一重工	1,200,000	15,696,000.00	3.90
5	000002	万科A	500,000	13,905,000.00	3.46
6	002415	海康威视	500,000	13,790,000.00	3.43
7	601021	春秋航空	300,000	13,500,000.00	3.35
8	300009	安科生物	800,000	12,720,000.00	3.16
9	600566	济川药业	400,000	12,044,000.00	2.99
10	600887	伊利股份	350,000	11,693,500.00	2.91

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,005,000.00	4.97
	其中:政策性金融债	20,005,000.00	4.97
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,005,000.00	4.97

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	160315	16进出15	100,000	10,022,000.00	2.49
2	190402	19农发02	100,000	9,983,000.00	2.48

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

本基金本期末未持有权证。

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同约定,本基金不参与国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据基金合同约定,本基金不参与国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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	182,411.08
2	应收证券清算款	1,127,153.09
3	应收股利	-
4	应收利息	255,623.27
5	应收申购款	264.60
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,565,452.04

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

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

报告期期初基金份额总额	489,994,894.67
报告期间基金总申购份额	1,660,734.43
减:报告期间基金总赎回份额	72,439,741.84
报告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	419,215,887.26

§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

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

报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过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、中国证监会批准圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;
2、《圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《圆信永丰优享生活灵活配置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
2019年07月19日

圆信永丰优加生活股票型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:2019年07月19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。基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	圆信永丰优加生活
基金主代码	001736
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年10月28日
报告期末基金份额总额	605,229,629.99份
投资目标	本基金主要投资于有利于引领和提升居民生活水平的上市公司,把握经济增长过程中居民需求升级蕴含的投资机会,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	基于对优加生活上市公司的界定,本基金主要采取"自下而上"的选股策略,基于对上市公司成长性和估值水平的综合考量,使用定性与定量相结合的方法精选股票进行投资。在行业配置的基础上,本基金管理人将采取"自下而上"的研究方法,充分发挥投研团队的主动选股能力,紧密围绕优加生活投资主题,从上市公司的基本面研究出发,挖掘出符合中国经济转型,具有像发式增长机会,有利于改善人类生活质量、持续成长能力的优质企业。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,具有较高预期风险和较高预期收益特征。
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(2019年04月01日 - 2019年06月30日)
1.本期已实现收益	75,818,785.35
2.本期利润	-23,231,943.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0359
4.期末基金资产净值	867,915,328.30
5.期末基金份额净值	1.434

注1:本期指2019年4月1日至2019年6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 本报告期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	-2.78%	1.49%	-0.90%	1.22%	-1.88%	0.27%

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

§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		
范妍	本基金基金经理	2015-10-28	-	11年	复旦大学管理学硕士,现任圆信永丰基金管理有限公司权益投资部总监。历任兴业证券研究中心助理策略分析师、安信证券研究中心高级策略分析师、工银瑞信基金策略研究员、圆信永丰基金管理有限公司权益投资部副总监。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遵规守信情况的说明

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、特定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

4月份,国债收益率上行,北上净流入资金出现负增长,这和一季度北上资金推动,国内融资加杠杆带来的行情出现了偏离。相应地我们调整了仓位,对市场的判断由乐观转向中性。

由于宏观经济环境偏弱,各个行业的盈利能力受到不同程度的影响,我们自下而上,平衡估值和业绩增长的不确定性,选择了一批长期增长前景仍然稳定的个股。对于投资者仓位比较集中的食品饮料行业和预期乐观的周期行业(我们称之为3月份"周期幻觉"),我们进行了减仓。

长期看,在大类资产的比较中,股票类资产的估值仍然处于历史的低位,债券、地产、理财、其它国家股市等资产类别的预期回报率在下降,仍有资产配置的压力。因此虽然宏观经济周期并不乐观,但是我们不排除资金面出现类似一季度的波动。

政策的主基调是不大水漫灌、支持实体经济发展、促经济转型、提高经济增长质量,与之相对应,直接融资的重要性提升,因此我们的配置上以经济转型的方向为主要的配置基础,部分低估值的行业为配置底仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰优加生活基金份额净值为1.434元,本报告期内,基金份额净值增长率为-2.78%,同期业绩比较基准收益率为-0.90%。

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	752,255,882.60	86.15
	其中:股票	752,255,882.60	86.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	42,428,423.54	4.86
	其中:债券	42,428,423.54	4.86
	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	60,000,000.00	6.87
	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	15,001,968.80	1.72
8	其他资产	3,502,635.76	0.40
9	合计	873,188,910.70	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	20,188,670.40	2.33
B	采矿业	23,088,712.85	2.66
C	制造业	538,174,476.47	62.01
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	24,511,210.00	2.82
G	交通运输、仓储和邮政业	54,488,601.46	6.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,210,808.76	2.21
J	金融业	19,081,869.94	2.20
K	房地产业	27,531,900.00	3.17
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	12,390,526.12	1.43
R	文化、体育和娱乐业	13,589,106.60	1.57
S	综合	-	-
	合计	752,255,882.60	86.67

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	000651	格力电器	908,100	49,945,500.00	5.75
2	002511	中顺洁柔	3,000,000	36,840,000.00	4.24
3	002179	中航光电	1,100,000	36,806,000.00	4.24
4	600031	三一重工	2,790,000	36,493,200.00	4.20
5	600566	济川药业	1,100,000	33,121,000.00	3.82
6	002415	海康威视	1,200,019	33,096,524.02	3.81
7	601021	春秋航空	699,991	31,499,595.00	3.63
8	600038	中直股份	764,561	31,362,292.22	3.61
9	000002	万科A	990,000	27,531,900.00	3.17
10	300009	安科生物	1,699,999	27,029,984.10	3.11

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,010,000.00	4.61
	其中:政策性金融债	40,010,000.00	4.61
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)	2,418,423.54	0.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	42,428,423.54	4.89

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	160315	16进出15	200,000	20,044,000.00	2.31
2	190402	19农发02	200,000	19,966,000.00	2.30
3	128047	光电转债	20,917	2,418,423.54	0.28

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

本基金本期末未持有权证。

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同约定,本基金不参与国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据基金合同约定,本基金不参与国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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	502,068.36
2	应收证券清算款	2,244,277.21
3	应收股利	-
4	应收利息	516,012.70
5	应收申购款	240,287.49
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,502,635.76

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	128047	光电转债	2,418,423.54	0.28

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

报告期期初基金份额总额	745,633,111.31
报告期期间基金总申购份额	33,304,446.34
减:报告期期间基金总赎回份额	173,707,927.66
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	605,229,629.99

§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	2019年4月1日-2019年6月30日	403,238,336.58	2,544,458.97	0.00	405,782,795.55	14.99%
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加生活股票型证券投资基金设立的文件;
2、《圆信永丰优加生活股票型证券投资基金基金合同》;
3、《圆信永丰优加生活股票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
2019年07月19日

圆信永丰丰润货币市场基金

2019年第二季度报告

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:2019年07月19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。基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	丰润货币
基金主代码	004178
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年03月10日
报告期末基金份额总额	2,707,498,296.84份
投资目标	本基金将以价值分析为基础,宏观与微观、定性与定量相结合,通过专业的流动性管理力争为投资者实现资产的保值、增值。结合宏观分析和微观分析制定投资策略,力求在满足流动性需要的基础上实现更高的收益率。
投资策略	本基金的投资将以保证资产的流动性为基本原则,力求在对国内外宏观经济走势、货币财政政策变动等因素充分评估的基础上,科学预计未来利率走势,择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具,进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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
下属分级基金的基金简称	丰润货币A / 丰润货币B
下属分级基金的交易代码	004178 / 004179
报告期末下属分级基金的份额总额	3,124.27份 / 2,707,495,162.57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(2019年04月01日 - 2019年06月30日)	
	丰润货币A	丰润货币B
1.本期已实现收益	16.51	12,416,556.56
2.本期利润	16.51	12,416,556.56
3.期末基金资产净值	3,124.27	2,707,495,162.57

注1:本基金无持有人认购或交易基金的各项费