

圆信永丰强化收益债券型证券投资基金

2024年第2季度报告

2024年06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:2024年07月19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遵规守信情况的说明	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	9
§5 投资组合报告	9
5.1 报告期末基金资产组合情况	9
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	11
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	12
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	12
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	12
5.11 投资组合报告附注	12
§6 开放式基金份额变动	15
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	15
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	15
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	15
§8 影响投资者决策的其他重要信息	16
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	16
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	16
§9 备查文件目录	16
9.1 备查文件目录	16
9.2 存放地点	16
9.3 查阅方式	16

§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2024年7月18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4月1日起至2024年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	圆信永丰强化收益
基金主代码	002932
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年07月27日
报告期末基金份额总额	1,171,779,810.11份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金所定义的强化收益是指在债券配置基础上，进行适当的股票投资以强化组合获利能力，提高预期收益水平。在控制风险的前提下，投资质地优秀、发展前景良好、治理结构完善、财务状况良好的公司，根据本基金的风险收益要求进行股票投资。本基金通过综合分析国内外宏观经济运行状况和金融市场运行趋势等因素，在严格控制风险的前提下，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例。在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，适当参与股票市场投资，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。本基金的投资策略包括债券资产配置策略、信用类固定收益类证券的投资策略、息差策略、互换策略、中小企业私募债券投资策略、可转债投资策略、资产支持证券投资策略、流动性

	管理策略、回购策略、股票投资策略、权证投资策略。	
业绩比较基准	中证全债指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种，其预期风险收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。	
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	圆信永丰强化收益A类	圆信永丰强化收益C类
下属分级基金的交易代码	002932	002933
报告期末下属分级基金的份额总额	1,145,261,925.35份	26,517,884.76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04月01日 - 2024年06月30日)	
	圆信永丰强化收益A类	圆信永丰强化收益C类
1.本期已实现收益	3,433,843.67	25,205.42
2.本期利润	17,920,066.09	178,473.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0143	0.0082
4.期末基金资产净值	1,281,024,417.51	29,204,197.76
5.期末基金份额净值	1.1185	1.1013

注1：本期指2024年4月1日至2024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

圆信永丰强化收益A类净值表现

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	1.15%	0.20%	1.92%	0.08%	-0.77%	0.12%
过去六个月	1.09%	0.28%	4.31%	0.08%	-3.22%	0.20%
过去一年	-0.26%	0.24%	6.59%	0.07%	-6.85%	0.17%
过去三年	0.50%	0.27%	17.29%	0.06%	-16.79%	0.21%
过去五年	18.72%	0.29%	27.16%	0.07%	-8.44%	0.22%
自基金合同生效起至今	36.07%	0.27%	40.14%	0.07%	-4.07%	0.20%

圆信永丰强化收益C类净值表现

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	1.06%	0.20%	1.92%	0.08%	-0.86%	0.12%
过去六个月	0.90%	0.28%	4.31%	0.08%	-3.41%	0.20%
过去一年	-0.66%	0.24%	6.59%	0.07%	-7.25%	0.17%
过去三年	-0.70%	0.27%	17.29%	0.06%	-17.99%	0.21%
过去五年	16.40%	0.29%	27.16%	0.07%	-10.76%	0.22%
自基金合同生效起至今	31.91%	0.27%	40.14%	0.07%	-8.23%	0.20%

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

圆信永丰强化收益A类累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年07月27日-2024年06月30日)



圆信永丰强化收益C类累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年07月27日-2024年06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		
林铮	本基金基金经理	2020-02-25	-	15年	厦门大学经济学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司

					司固收投资部总监。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、固收投资部副总监。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格证。
范妍	本基金基金经理	2021-11-18	2024-04-03	16年	复旦大学管理学硕士，历任兴业证券股份有限公司研究部策略研究助理，安信证券股份有限公司研究部策略分析师，工银瑞信基金管理有限公司专户部高级策略分析师，圆信永丰基金管理有限公司权益投资部基金经理助理、副总监、总监、圆信永丰基金管理有限公司副总经理兼首席投资官。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，基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在风险可控的前提下为基金份额持有人谋求最大利益。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

2024年2季度，债券市场无风险利率整体呈现震荡走低后低位震荡的走势。3月跨季后，受市场配置资金推动，整体无风险利率呈现加速下行走势，利率曲线快速创出年内新低，10年期国债逼近2.2%，30年国债逼近2.4%，信用利差整体创出2023年来新低。4月中下旬，随着经济高频数据转好，市场风险偏好提升，叠加央行对长债风险提示，无风险收益率快速走高，10年和30年国债收益率回到2.35%和2.6%附近，但随着5月中下旬经济高频数据再度走弱，市场风险偏好再度下行，资金偏好再度回到债券端，无风险收益率继续下行，截止6月底，中短端利率再度创出年内新低，长端利率基本也回到年内低位。

A股市场方面，指数整体呈现区间震荡走势，但行业层面分化较大，除银行、公用电力、交运、煤炭、电子等少数板块外，大部分行业指数均录得负收益，宏观层面上看，由于经济复苏趋势较弱限制了资金配置风险偏好，整体上市场仍然偏好红利资产和现金相对稳定的品种。

操作层面，二季度由于债券整体收益较低，产品以滚动配置性价比较高的中短端品种为主，在4月底5月初适当参与长端利率波段交易；转债方面，二季度内，品种估值出现了一定的波动，但整体还处于合理区间，主要持有性价比较高的个券，并根据品种估值高低，适当调整转债整体仓位；权益方面，报告期内增加配置了交运、银行、煤炭、化工、机械等行业，并减持了电力设备、钢铁、家电、建筑建材。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰强化收益A类基金份额净值为1.1185元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.15%，同期业绩比较基准收益率为1.92%；截至报告期末圆信永丰强化收益C类基金份额净值为1.1013元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.06%，同期业绩比较基准收益率为1.92%。

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	190,156,384.62	11.98
	其中：股票	190,156,384.62	11.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,365,368,905.63	86.00
	其中：债券	1,365,368,905.63	86.00
	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	8,500,000.00	0.54
	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	13,274,668.75	0.84
8	其他资产	10,292,977.25	0.65
9	合计	1,587,592,936.25	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	3,306,820.00	0.25
B	采矿业	9,896,601.00	0.76

C	制造业	141,554,285.02	10.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,132,320.00	0.09
E	建筑业	1,200,400.00	0.09
F	批发和零售业	771,318.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	12,912,777.00	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,289,733.60	0.48
J	金融业	5,823,077.00	0.44
K	房地产业	3,455,520.00	0.26
L	租赁和商务服务业	204,222.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	1,387,399.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	1,758,400.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	463,512.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	190,156,384.62	14.51

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	688008	澜起科技	139,500	7,973,820.00	0.61
2	300750	宁德时代	43,500	7,831,305.00	0.60
3	002179	中航光电	175,600	6,681,580.00	0.51
4	601816	京沪高铁	973,100	5,225,547.00	0.40

5	600862	中航高科	252,600	4,743,828.00	0.36
6	002353	杰瑞股份	133,600	4,686,688.00	0.36
7	600256	广汇能源	692,600	4,640,420.00	0.35
8	002371	北方华创	13,000	4,158,570.00	0.32
9	600519	贵州茅台	2,800	4,108,692.00	0.31
10	300054	鼎龙股份	175,000	3,969,000.00	0.30

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	49,622,594.19	3.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	205,614,723.33	15.69
	其中：政策性金融债	61,468,904.36	4.69
4	企业债券	473,753,677.24	36.16
5	企业短期融资券	40,123,137.41	3.06
6	中期票据	431,214,759.57	32.91
7	可转债（可交换债）	165,040,013.89	12.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,365,368,905.63	104.21

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	137657	22平证07	500,000	52,599,791.78	4.01
2	270087	23京投03	500,000	51,581,945.21	3.94
3	019685	22国债20	488,000	49,622,594.19	3.79
4	188706	21两江03	400,000	42,170,005.48	3.22
5	149563	21广发06	400,000	42,097,457.54	3.21

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

根据基金合同约定，本基金不参与股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

通过查阅中国证监会、国家金融监督管理总局网站公开目录“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	87,106.89
2	应收证券清算款	10,205,186.27
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	684.09
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,292,977.25

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	110075	南航转债	13,865,146.04	1.06

2	110079	杭银转债	12,547,715.50	0.96
3	113045	环旭转债	8,338,992.61	0.64
4	118013	道通转债	6,623,735.07	0.51
5	113052	兴业转债	6,620,757.13	0.51
6	127027	能化转债	6,618,130.96	0.51
7	128081	海亮转债	5,354,762.99	0.41
8	128134	鸿路转债	4,975,458.68	0.38
9	123107	温氏转债	4,795,563.56	0.37
10	128141	旺能转债	4,638,237.53	0.35
11	113060	浙22转债	4,578,746.24	0.35
12	110085	通22转债	4,124,913.53	0.31
13	113033	利群转债	4,066,360.55	0.31
14	113042	上银转债	3,660,286.92	0.28
15	128074	游族转债	3,403,664.96	0.26
16	127074	麦米转2	3,357,368.77	0.26
17	118025	奕瑞转债	3,094,758.63	0.24
18	127045	牧原转债	2,981,219.94	0.23
19	123169	正海转债	2,891,751.95	0.22
20	113021	中信转债	2,835,678.90	0.22
21	128109	楚江转债	2,770,663.01	0.21
22	127032	苏行转债	2,364,473.69	0.18
23	113024	核建转债	2,207,164.38	0.17
24	118024	冠宇转债	2,168,955.58	0.17
25	113061	拓普转债	2,136,574.85	0.16
26	110059	浦发转债	2,117,287.10	0.16
27	113631	皖天转债	2,108,973.42	0.16
28	110073	国投转债	2,087,943.26	0.16
29	127042	嘉美转债	1,932,745.73	0.15
30	127076	中宠转2	1,898,879.53	0.14
31	113542	好客转债	1,694,592.10	0.13
32	113669	景23转债	1,429,125.53	0.11
33	123149	通裕转债	1,426,905.47	0.11
34	128066	亚泰转债	1,367,664.38	0.10

35	113655	欧22转债	1,295,059.61	0.10
36	123119	康泰转2	1,285,618.68	0.10
37	113623	凤21转债	1,238,461.64	0.09
38	127054	双箭转债	1,202,968.49	0.09
39	127043	川恒转债	1,111,121.51	0.08
40	113644	艾迪转债	1,087,353.55	0.08
41	123145	药石转债	1,018,780.27	0.08
42	113037	紫银转债	1,009,091.46	0.08
43	118023	广大转债	957,231.37	0.07
44	113053	隆22转债	944,243.31	0.07
45	118034	晶能转债	930,348.36	0.07
46	113046	金田转债	854,924.17	0.07
47	127020	中金转债	832,298.14	0.06
48	127049	希望转2	796,969.83	0.06
49	113632	鹤21转债	790,635.79	0.06
50	123176	精测转2	779,916.49	0.06
51	123208	孩王转债	726,400.81	0.06
52	127095	广泰转债	713,637.21	0.05
53	111001	山玻转债	710,973.00	0.05
54	113048	晶科转债	626,580.41	0.05
55	123099	普利转债	620,050.79	0.05
56	127091	科数转债	565,025.75	0.04
57	113059	福莱转债	543,673.36	0.04
58	110067	华安转债	519,081.88	0.04
59	110076	华海转债	493,054.57	0.04
60	123130	设研转债	469,476.12	0.04
61	113621	彤程转债	460,470.07	0.04
62	123108	乐普转2	456,856.74	0.03
63	113679	芯能转债	441,887.96	0.03
64	123210	信服转债	427,879.99	0.03
65	113050	南银转债	385,015.09	0.03
66	127086	恒邦转债	372,559.97	0.03
67	113044	大秦转债	360,795.29	0.03

68	123231	信测转债	358,267.73	0.03
69	127051	博杰转债	324,339.87	0.02
70	113069	博23转债	314,052.72	0.02
71	113639	华正转债	245,887.90	0.02
72	127083	山路转债	214,661.56	0.02
73	123172	漱玉转债	195,917.65	0.01
74	113661	福22转债	180,804.04	0.01
75	113047	旗滨转债	131,582.30	0.01
76	113658	密卫转债	121,825.62	0.01
77	127093	章鼓转债	113,460.82	0.01
78	127089	晶澳转债	97,302.55	0.01
79	123212	立中转债	58,751.45	0.00

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

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

	圆信永丰强化收益A类	圆信永丰强化收益C类
报告期期初基金份额总额	1,366,593,631.76	19,915,219.45
报告期期间基金总申购份额	188,539.54	9,090,826.92
减：报告期期间基金总赎回份额	221,520,245.95	2,488,161.61
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	1,145,261,925.35	26,517,884.76

§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，基金管理人未持有本基金份额。

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，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

§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强化收益债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《圆信永丰强化收益债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《圆信永丰强化收益债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、报告期内在规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

2024年07月19日