

圆信永丰强化收益债券型证券投资基金

2022年第2季度报告

2022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:2022年07月21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 | 8 |
| 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 | 9 |
| 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 | 10 |
| 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 | 11 |
| 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 | 12 |
| 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 | 12 |
| 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 | 12 |
| 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 | 16 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 | 16 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 | 16 |
| §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2022年7月20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2022年4月1日起至2022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 | 2,030,007,722.23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 | 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。 |
| 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 | 2,021,293,804.32份 | 8,713,917.91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(2022年04月01日 - 2022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 | -15,763,731.53 | -69,005.74 |
| 2. 本期利润 | 42,583,218.20 | 178,861.47 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0170 | 0.0199 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2,222,771,263.69 | 9,511,079.33 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0997 | 1.0915 |

注1：本期指2022年4月1日至2022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 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 | 2.01% | 0.37% | 1.11% | 0.05% | 0.90% | 0.32% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去六个月 | -2.53% | 0.38% | 1.90% | 0.06% | -4.43% | 0.32% |
| 过去一年 | -1.19% | 0.35% | 5.22% | 0.06% | -6.41% | 0.29% |
| 过去三年 | 16.73% | 0.34% | 14.08% | 0.07% | 2.65% | 0.27% |
| 过去五年 | 31.96% | 0.31% | 26.56% | 0.07% | 5.40% | 0.24% |
| 自基金合同生效起至今 | 33.78% | 0.29% | 25.72% | 0.07% | 8.06% | 0.22% |

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 | 1.90% | 0.37% | 1.11% | 0.05% | 0.79% | 0.32% |
| 过去六个月 | -2.74% | 0.38% | 1.90% | 0.06% | -4.64% | 0.32% |
| 过去一年 | -1.59% | 0.35% | 5.22% | 0.06% | -6.81% | 0.29% |
| 过去三年 | 15.37% | 0.34% | 14.08% | 0.07% | 1.29% | 0.27% |
| 过去五年 | 29.43% | 0.31% | 26.56% | 0.07% | 2.87% | 0.24% |
| 自基金合同生效起至今 | 30.73% | 0.29% | 25.72% | 0.07% | 5.01% | 0.22% |

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-2022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-2022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 | - | 13 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 | - | 14 年 | 复旦大学管理学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司副总经理兼首席投资官。历任兴业证券股份有限公司研究所行业与公司研究员，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研究部高级策略研究员，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。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

2022年2季度，债券市场整体收益率整体呈现区间震荡的走势。4月份影响债券市场最大的因素是疫情对经济负面影响开始加大、政策对冲初期相对温和，央行不及市场预期的降准，10年国债利率先下后上；进入5月份，随着经济持续趋弱，市场对于经济悲观预期加大，因此经济基本面主导了利率的走势，使得利率在5月呈现单边下行走势；但随着政策对于稳增长力度加大，而且整体上以结构性政策为主，政策明显倾向于宽信用；随着疫情对经济影响逐步减弱，利率走势重新回到对于经济复苏预期上，从5月底开始，10年国债利率开始反弹，基本回到4月中旬的高点附近。

信用方面，由于二季度整体流动性维持宽松，经济基本面趋弱下，机构整体资金配置压力加大；在配置资金推动下，二季度整体信用利差在4~5月出现了单边下行的走势，整体利差水平再度来到过去一年的低位；受经济基本面弱化影响，信用资产内部分化较

大，城投整体仍处于利差压缩状态，在配置压力推动下，部分高负债区域的高等级城投受到了市场的青睐；但产业债方面，受房地产基本面继续恶化以及海外利率上升导致整体流动性收缩影响，房地产及部分民营企业受到了较大影响，信用风险持续点状爆发；但从趋势上看，随着疫情影响弱化以及海外对美联储未来加息的充分预期，信用风险继续恶化的概率在降低。

A股市场在二季度出现了较大的波动。先是在俄乌战争、国外通胀的背景下，投资者普遍认为全球货币政策进入了紧缩周期，叠加美国加息、十年期美债收益率破3，成长股成为抛售的对象。同时，二季度初，对于国内的经济，投资者普遍预期“稳增长”，在这样的预期下，银行、地产、建筑、煤炭等板块优于成长类型的行业。

2季度组合操作上，受疫情影响，整体宏观形势对于债券市场是先松后紧，因此债券方面，根据市场整体特征，季度初在高等级国企以及金融债中拉长久期，随着利差下行，适当降低了久期方面的暴露，在资金仍然较为宽松的背景下，组合持续票息策略。转债方面，随着权益市场估值在二季度出现大幅压缩后，组合增加基本面较好品种配置，整体上以获取相对纯债超额收益为主要标准进行操作。

权益方面，我们的判断和市场普遍预期是有差异的。第一，海外紧缩周期不等同于国内紧缩周期，对于流动性层面，我们认为国内仍然是一个宽松的环境，国内成长股的估值不由美债收益率决定。事后看，北上资金二季度呈现净流入的状态。第二，我们跟踪的高频数据显示政府投资增长更快的是新基建，传统基建投资力度有限。结合这两点，我们的配置重点仍然放在了成长类型的板块上，例如TMT、电力设备、军工。同时，由于海外需求下降速度快于我们的预期，国内需求恢复速度不及预期，一二季度我们陆续减持了之前持有的钢铁、玻璃、电解铝、纯碱、硅铁、银行、地产等周期股，增加了景气度超预期的光伏、新能源车等产业链的配置。

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1.0997元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.01%，同期业绩比较基准收益率为1.11%；截至报告期末圆信永丰强化收益C类基金份额净值为1.0915元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.90%，同期业绩比较基准收益率为1.11%。

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 | 405,086,481.16 | 15.27 |
| | 其中：股票 | 405,086,481.16 | 15.27 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,229,759,098.86 | 84.05 |
| | 其中：债券 | 2,229,759,098.86 | 84.05 |
| | 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 | 9,020,506.50 | 0.34 |
| 8 | 其他资产 | 9,153,036.36 | 0.35 |
| 9 | 合计 | 2,653,019,122.88 | 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 | 5,786,606.00 | 0.26 |
| B | 采矿业 | 10,455,588.00 | 0.47 |
| C | 制造业 | 316,026,217.87 | 14.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 27,026,433.00 | 1.21 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,716,238.00 | 0.35 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 22,651,778.85 | 1.01 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 8,404,524.40 | 0.38 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 7,019,095.04 | 0.31 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 405,086,481.16 | 18.15 |

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 | 003816 | 中国广核 | 4,518,500 | 12,651,800.00 | 0.57 |
| 2 | 002371 | 北方华创 | 43,600 | 12,082,432.00 | 0.54 |
| 3 | 002028 | 思源电气 | 336,021 | 11,982,508.86 | 0.54 |
| 4 | 600862 | 中航高科 | 406,606 | 11,425,628.60 | 0.51 |
| 5 | 300750 | 宁德时代 | 21,300 | 11,374,200.00 | 0.51 |
| 6 | 601126 | 四方股份 | 671,891 | 10,891,353.11 | 0.49 |
| 7 | 002179 | 中航光电 | 153,000 | 9,687,960.00 | 0.43 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 4,700 | 9,611,500.00 | 0.43 |
| 9 | 300850 | 新强联 | 102,400 | 9,116,672.00 | 0.41 |
| 10 | 600426 | 华鲁恒升 | 301,500 | 8,803,800.00 | 0.39 |

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 | 16,179,572.60 | 0.72 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 460,628,831.23 | 20.63 |
| | 其中：政策性金融债 | 172,584,290.41 | 7.73 |

| | | | |
|----|-----------|------------------|-------|
| 4 | 企业债券 | 828,328,043.68 | 37.11 |
| 5 | 企业短期融资券 | 245,586,278.92 | 11.00 |
| 6 | 中期票据 | 532,805,132.45 | 23.87 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 146,231,239.98 | 6.55 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,229,759,098.86 | 99.89 |

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 | 2128025 | 21建设银行二级01 | 600,000 | 62,080,520.55 | 2.78 |
| 2 | 2128028 | 21邮储银行二级01 | 600,000 | 61,957,436.71 | 2.78 |
| 3 | 188706 | 21两江03 | 500,000 | 51,702,506.85 | 2.32 |
| 4 | 2128033 | 21建设银行二级03 | 500,000 | 51,558,178.08 | 2.31 |
| 5 | 2128042 | 21兴业银行二级02 | 500,000 | 51,439,832.88 | 2.30 |

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

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、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除21建设银行二级01（2128025. IB）、21建设银行二级03（2128033. IB）的发行主体中国建设银行股份有限公司、21邮储银行二级01（2128028. IB）的发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司、21兴业银行二级02（2128042. IB）的发行主体兴业银行股份有限公司外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。

2021年8月13日，中国建设银行股份有限公司因占压财政存款或者资金、违反账户管理规定，被中国人民银行出具行政处罚（银罚字[2021]22号），警告并处罚款388万元。2022年3月21日，中国建设银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在多项违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会出具行政处罚（银保监罚决字[2022]14号），罚款470万元。

2021年8月13日，中国邮政储蓄银行股份有限公司因违反账户管理规定，被中国人民银行出具行政处罚（银罚字[2021]16号），警告并处罚款600万元。2022年3月21日，中国邮政储蓄银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在多项违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会出具行政处罚（银保监罚决字[2022]16号），罚款370万元。

2021年8月13日，兴业银行股份有限公司因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被中国人民银行出具行政处罚（银罚字[2021]26号），罚款5万元。2022年3月21日，兴业银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在多项违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会出具行政处罚（银保监罚决字[2022]22号），罚款350万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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 | 177,957.95 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,941,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 5,034,078.41 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 9,153,036.36 |

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 | 110062 | 烽火转债 | 11,918,250.00 | 0.53 |
| 2 | 113024 | 核建转债 | 10,180,123.97 | 0.46 |
| 3 | 110053 | 苏银转债 | 10,078,358.36 | 0.45 |
| 4 | 113044 | 大秦转债 | 9,706,169.31 | 0.43 |
| 5 | 110056 | 亨通转债 | 8,314,230.82 | 0.37 |
| 6 | 113542 | 好客转债 | 7,348,782.00 | 0.33 |
| 7 | 110079 | 杭银转债 | 7,141,097.42 | 0.32 |
| 8 | 127035 | 濮耐转债 | 6,674,878.03 | 0.30 |
| 9 | 113033 | 利群转债 | 5,307,328.42 | 0.24 |
| 10 | 113042 | 上银转债 | 4,203,011.51 | 0.19 |
| 11 | 110047 | 山鹰转债 | 4,185,064.93 | 0.19 |
| 12 | 123087 | 明电转债 | 4,111,269.70 | 0.18 |
| 13 | 127042 | 嘉美转债 | 3,778,973.75 | 0.17 |
| 14 | 123116 | 万兴转债 | 3,571,612.60 | 0.16 |
| 15 | 110073 | 国投转债 | 3,209,995.07 | 0.14 |
| 16 | 110059 | 浦发转债 | 3,179,963.01 | 0.14 |
| 17 | 113052 | 兴业转债 | 3,126,802.96 | 0.14 |
| 18 | 127032 | 苏行转债 | 3,067,203.70 | 0.14 |
| 19 | 128066 | 亚泰转债 | 2,901,206.10 | 0.13 |
| 20 | 110063 | 鹰19转债 | 2,375,404.93 | 0.11 |
| 21 | 128075 | 远东转债 | 2,335,781.92 | 0.10 |
| 22 | 128081 | 海亮转债 | 2,173,561.78 | 0.10 |
| 23 | 127012 | 招路转债 | 2,170,314.82 | 0.10 |
| 24 | 127005 | 长证转债 | 2,083,282.52 | 0.09 |
| 25 | 113516 | 苏农转债 | 1,912,076.71 | 0.09 |
| 26 | 127049 | 希望转2 | 1,842,234.66 | 0.08 |
| 27 | 113037 | 紫银转债 | 1,723,386.93 | 0.08 |
| 28 | 113046 | 金田转债 | 1,693,210.27 | 0.08 |
| 29 | 128108 | 蓝帆转债 | 1,561,834.75 | 0.07 |
| 30 | 111001 | 山玻转债 | 1,524,054.25 | 0.07 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 31 | 110067 | 华安转债 | 1,432,027.64 | 0.06 |
| 32 | 123099 | 普利转债 | 1,193,967.40 | 0.05 |
| 33 | 127045 | 牧原转债 | 1,160,998.52 | 0.05 |
| 34 | 113619 | 世运转债 | 1,088,790.85 | 0.05 |
| 35 | 123107 | 温氏转债 | 1,050,344.11 | 0.05 |
| 36 | 113631 | 皖天转债 | 914,344.11 | 0.04 |
| 37 | 128071 | 合兴转债 | 825,784.25 | 0.04 |
| 38 | 127020 | 中金转债 | 704,480.05 | 0.03 |
| 39 | 128109 | 楚江转债 | 665,995.89 | 0.03 |
| 40 | 127016 | 鲁泰转债 | 641,530.55 | 0.03 |
| 41 | 128048 | 张行转债 | 632,447.26 | 0.03 |
| 42 | 113050 | 南银转债 | 613,420.14 | 0.03 |
| 43 | 113601 | 塞力转债 | 399,597.01 | 0.02 |
| 44 | 118003 | 华兴转债 | 383,132.14 | 0.02 |
| 45 | 113598 | 法兰转债 | 261,134.79 | 0.01 |
| 46 | 128122 | 兴森转债 | 186,698.84 | 0.01 |
| 47 | 113610 | 灵康转债 | 185,464.42 | 0.01 |
| 48 | 123077 | 汉得转债 | 126,159.32 | 0.01 |

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 | 2,751,176,752.83 | 9,084,265.93 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,888,943.90 | 135,272.99 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 734,771,892.41 | 505,621.01 |
| 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 | 2,021,293,804.32 | 8,713,917.91 |

§ 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

2022年07月21日