

# 圆信永丰强化收益债券型证券投资基金

2022年第3季度报告

2022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:2022年10月26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.....	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.....	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.....	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.....	14
§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.....	15
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.....	15
8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	15
§9 备查文件目录.....	15
9.1 备查文件目录.....	15
9.2 存放地点.....	15
9.3 查阅方式.....	15

## § 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10月25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7月1日起至2022年9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	1,792,024,147.91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	1,751,416,567.48份	40,607,580.43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07月01日 - 2022年09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	-14,870,327.47	-496,172.86
2. 本期利润	-32,020,811.84	-1,223,458.14
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0169	-0.0507
4. 期末基金资产净值	1,893,299,314.69	43,524,544.23
5. 期末基金份额净值	1.0810	1.0718

注1：本期指2022年7月1日至2022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	-1.70%	0.25%	1.70%	0.06%	-3.40%	0.19%
过去六个月	0.28%	0.31%	2.82%	0.06%	-2.54%	0.25%
过去一年	-1.03%	0.32%	5.05%	0.06%	-6.08%	0.26%
过去三年	12.66%	0.34%	14.29%	0.07%	-1.63%	0.27%
过去五年	28.71%	0.31%	27.99%	0.07%	0.72%	0.24%
自基金合同生效起至今	31.51%	0.28%	27.86%	0.07%	3.65%	0.21%

## 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	-1.80%	0.25%	1.70%	0.06%	-3.50%	0.19%
过去六个月	0.07%	0.31%	2.82%	0.06%	-2.75%	0.25%
过去一年	-1.43%	0.31%	5.05%	0.06%	-6.48%	0.25%
过去三年	11.34%	0.34%	14.29%	0.07%	-2.95%	0.27%
过去五年	26.24%	0.31%	27.99%	0.07%	-1.75%	0.24%
自基金合同生效起至今	28.37%	0.28%	27.86%	0.07%	0.51%	0.21%

## 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09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09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	说明
----	----	-------------	----	----

		任职日期	离任日期	从业年限	
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3季度，债券市场收益率呈现区间下移的震荡走势，10年国债利率中枢较二季度下移了近10bp。三季度前半段，市场收益率主要受经济数据和政策低于预期，房地产事件影响，无风险收益率震荡下行，叠加资产荒背景，信用利差创出年内新低；但地产信用风险也呈现点状爆发，信用利差分化持续加大；在8月政策利率意外下调后，市场无风险利率加速下行，利率中枢下移，无风险利率创出年内新低。9月，受人民币贬值，资金面收紧以及宽信用政策落地等因素影响，无风险利率出现较大反弹，月底10年期利率债收益率基本回到8月降息前的位置。3季度内，股票市场以调整为主。一方面，海外俄乌冲突，能源供应不稳定性增加；另一方面，高通胀率下，美国加息的预期在不断向上修正，美元走强。能源依赖度高的国家如欧元区和日本，在本币贬值后，进口能源的成本价格进一步抬升，经济进一步恶化，形成负向循环。

3季度组合在债券操作上，根据市场整体特征，8月以前组合在高等级信用以及金融债中适当拉长久期，以提升组合收益率，随着利率下行以及资金面收紧，9月降低了久

期方面的暴露。转债方面，整体上以性价比较高的品种进行配置力争获取相对纯债超额收益。

权益方面，组合仓位维持在中性水平，配置上仍然以符合经济长期发展方向和产业升级方向的行业为主，如精细化工、TMT、军工等行业。我们预期全球通货膨胀和经济增长下降的组合可能向通货膨胀下降和经济增长速度下降的组合演变，配置上，如果成本下降，而终端需求相对稳定的行业，我们在二、三季度增加了一定的配置比例。

#### 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1.0810元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.70%，同期业绩比较基准收益率为1.70%；截至报告期末圆信永丰强化收益C类基金份额净值为1.0718元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.80%，同期业绩比较基准收益率为1.70%。

#### 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	300,028,335.52	14.28
	其中：股票	300,028,335.52	14.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,792,008,488.76	85.29
	其中：债券	1,792,008,488.76	85.29
	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	5,225,107.31	0.25
8	其他资产	3,706,437.99	0.18

9	合计	2,100,968,369.58	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	6,195,200.00	0.32
B	采矿业	6,266,216.00	0.32
C	制造业	227,381,770.22	11.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,890,797.00	0.98
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,392,800.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,801,400.00	1.02
J	金融业	3,656,719.30	0.19
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,870,000.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,573,433.00	0.49
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	300,028,335.52	15.49

### 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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净
---	------	------	-------	---------	--------

号					值比例 (%)
1	300054	鼎龙股份	490,000	11,515,000.00	0.59
2	603613	国联股份	90,000	9,716,400.00	0.50
3	600862	中航高科	320,000	7,904,000.00	0.41
4	002028	思源电气	195,000	7,452,900.00	0.38
5	688037	芯源微	34,000	7,413,360.00	0.38
6	000063	中兴通讯	340,000	7,276,000.00	0.38
7	002371	北方华创	25,200	7,015,680.00	0.36
8	002179	中航光电	120,000	6,960,000.00	0.36
9	601677	明泰铝业	356,000	6,472,080.00	0.33
10	002299	圣农发展	320,000	6,195,200.00	0.32

#### 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	409,618,575.90	21.15
	其中：政策性金融债	162,204,498.64	8.37
4	企业债券	673,136,794.05	34.75
5	企业短期融资券	101,070,242.13	5.22
6	中期票据	489,122,581.71	25.25
7	可转债（可交换债）	119,060,294.97	6.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,792,008,488.76	92.52

#### 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	61,393,923.29	3.17
2	2128028	21邮储银行二级01	600,000	61,286,429.59	3.16

3	2128033	21建设银行二级03	500,000	52,756,136.99	2.72
4	185688	22恒信G1	500,000	51,036,632.88	2.64
5	220401	22农发01	500,000	50,532,698.63	2.61

#### 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、22农发01（220401.IB）的发行主体中国农业发展银行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。

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。

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。

2022年3月21日，中国农业发展银行因监管标准化数据（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]10号），罚款480万元。

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	97,593.26
2	应收证券清算款	3,487,453.83
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	121,390.90
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,706,437.99

#### 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	10,092,240.41	0.52
2	113024	核建转债	9,711,133.56	0.50
3	113044	大秦转债	8,875,112.33	0.46
4	110079	杭银转债	8,246,565.59	0.43
5	110053	苏银转债	6,954,379.31	0.36
6	113542	好客转债	6,953,974.52	0.36
7	127035	濮耐转债	5,901,287.48	0.30
8	113052	兴业转债	4,796,633.84	0.25
9	113033	利群转债	4,667,697.12	0.24
10	127049	希望转2	4,373,250.99	0.23
11	110047	山鹰转债	4,039,643.84	0.21
12	113042	上银转债	3,732,631.10	0.19
13	123116	万兴转债	3,387,147.12	0.17

14	127042	嘉美转债	3,279,542.47	0.17
15	127012	招路转债	3,263,199.33	0.17
16	110073	国投转债	3,129,022.19	0.16
17	127032	苏行转债	3,067,500.66	0.16
18	128066	亚泰转债	2,886,226.03	0.15
19	123087	明电转债	2,685,905.34	0.14
20	110063	鹰19转债	2,306,136.00	0.12
21	127005	长证转债	2,002,335.78	0.10
22	113516	苏农转债	1,934,507.40	0.10
23	113046	金田转债	1,655,122.60	0.09
24	113037	紫银转债	1,561,261.64	0.08
25	110067	华安转债	1,417,350.47	0.07
26	111001	山玻转债	1,366,020.16	0.07
27	123099	普利转债	1,110,377.26	0.06
28	113631	皖天转债	809,293.40	0.04
29	128071	合兴转债	773,508.63	0.04
30	128108	蓝帆转债	702,703.15	0.04
31	128134	鸿路转债	633,556.16	0.03
32	128048	张行转债	602,009.59	0.03
33	113050	南银转债	600,923.42	0.03
34	127020	中金转债	576,980.00	0.03
35	113601	塞力转债	377,264.52	0.02
36	113610	灵康转债	221,612.82	0.01
37	113054	绿动转债	160,733.34	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, 021, 293, 804. 32	8, 713, 917. 91
报告期期间基金总申购份额	144, 415, 595. 43	35, 099, 024. 65
减：报告期期间基金总赎回份额	414, 292, 832. 27	3, 205, 362. 13
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, 751, 416, 567. 48	40, 607, 580. 43

## § 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10月26日