

圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资 基金 2015 年半年度报告 摘要

2015 年 6 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

送出日期：2015 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示

1.1 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2015 年 8 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 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| 基金简称 | 圆信永丰双利 | |
| 基金主代码 | 000824 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2014 年 11 月 19 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 552, 134, 156. 28 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 圆信永丰双利 A | 圆信永丰双利 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 000824 | 000825 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 353, 763, 745. 76 份 | 198, 370, 410. 52 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 关注中国经济结构转型等制度红利所带来的相关产业投资机会，兼顾投资基本面良好，有稳定分红政策或高分红预期的上市公司来均衡组合风险，在充分控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金坚持“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略，在投资策略上体现“双红利”的主题思想。“自上而下”关注政府深化改革、经济转型、经济体制不断完善等制度红利所释放的相关产业投资机会，此为本基金的主要投资策略。“自下而上”精选基本面良好、具稳定分红政策或较高分红预期的公司发行的股票和/或债券，此为本基金为控制组合风险所采取的辅助策略。 |
| 业绩比较基准 | 70%*沪深 300 指数收益率+30%*中债综合指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|--------------|------------------------|
| 名称 | 圆信永丰基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 吕富强 |
| | 联系电话 | 021-60366000 |
| | 电子邮箱 | service@gtsfund.com.cn |
| 客户服务电话 | 4006070088 | 95588 |
| 传真 | 021-60366006 | 010-66105798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|--|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.gtsfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 19 楼 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别 | 圆信永丰双利 A | 圆信永丰双利 C |
|---------------|--------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2015 年 1 月 1 日- 2015 年 6 月 30 日) | 报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 323,290,048.56 | 107,785,276.83 |
| 本期利润 | 294,729,980.43 | 85,506,234.12 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.6629 | 0.6186 |
| 本期基金份额净值增长率 | 65.69% | 63.76% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015 年 6 月 30 日) | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5038 | 0.4900 |
| 期末基金资产净值 | 531,979,021.03 | 295,704,348.38 |
| 期末基金份额净值 | 1.504 | 1.491 |

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

圆信永丰双利 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -8.79% | 3.37% | -5.15% | 2.45% | -3.64% | 0.92% |
| 过去三个月 | 24.77% | 2.65% | 8.09% | 1.83% | 16.68% | 0.82% |
| 过去六个月 | 65.69% | 2.14% | 19.14% | 1.58% | 46.55% | 0.56% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 82.92% | 1.98% | 50.05% | 1.57% | 32.87% | 0.41% |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|

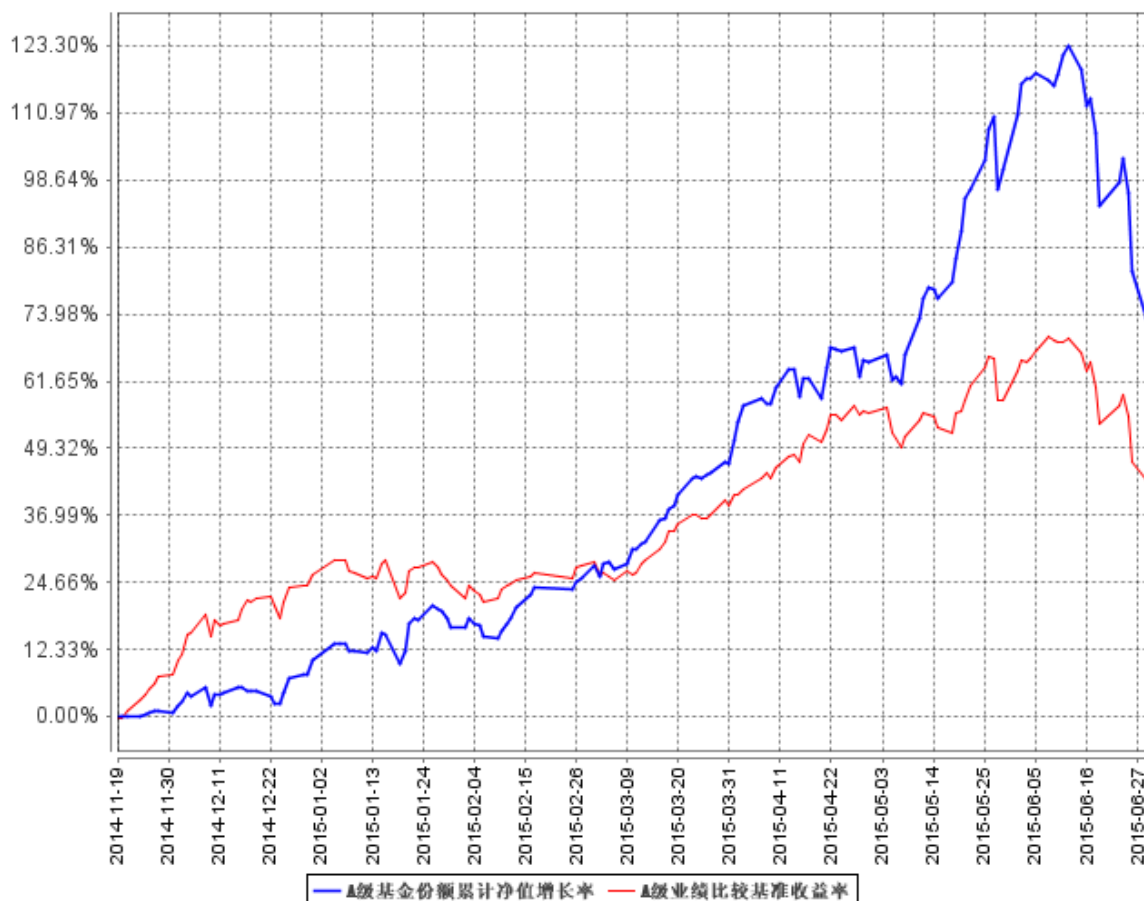
圆信永丰双利 C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -8.92% | 3.38% | -5.15% | 2.45% | -3.77% | 0.93% |
| 过去三个月 | 23.97% | 2.65% | 8.09% | 1.83% | 15.88% | 0.82% |
| 过去六个月 | 63.76% | 2.14% | 19.14% | 1.58% | 44.62% | 0.56% |
| 自基金合同生效起至今 | 80.63% | 1.98% | 50.05% | 1.57% | 30.58% | 0.41% |

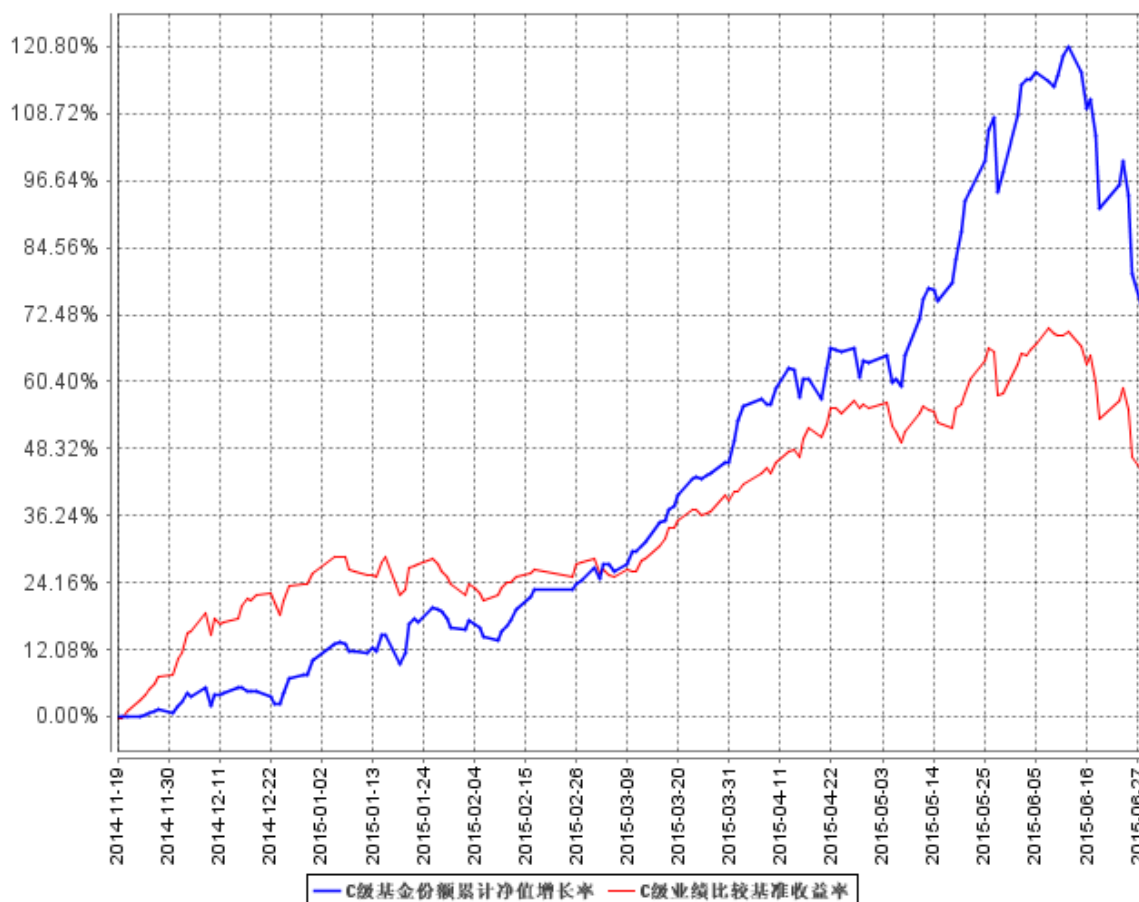
注：本基金于 2014 年 11 月 19 日成立，截止报告期末，本基金成立不满一年。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

圆信永丰基金管理有限公司是经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”或“证监会”）证监许可[2013]1514号文批准，于2014年1月2日成立的合资基金管理公司。本公司由厦门国际信托有限公司与台湾永丰证券投资信托股份有限公司合资设立，持股比例分别为51%和49%，注册资本贰亿元人民币。公司注册地位于厦门，主要业务经营团队位于上海，是厦门首家证券投资基金管理公司，也是海西首家两岸合资的证券投资基金管理公司。

截止报告期末，公司已成功推出二只开放式基金产品，包括一只混合型基金和一只债券型基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理 (助理) 期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----------|----------------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 洪流 | 本基金的基金经理 | 2014 年 11 月 19 日 | - | 16 | 上海财经大学金融学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司首席投资官。历任新疆金新信托证券管理总部信息研究部经理，德恒证券信息研究部副总经理，德恒证券经纪业务管理总部副总经理，兴业证券股份有限公司理财服务中心首席理财分析师，兴业证券股份有限公司上海资产管理分公司副总监。具有十六年证券行业从业经验。 |

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，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《圆信永丰双利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在风险可控的前提下为基金份额持有人谋求最大利益。基金经理对个券及投资组合的投资比例严格遵循法律法规、基金合同和公募基金投资决策委员会的授权限制。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，基金投资策略分为两个阶段。年初由于许多小市值成长股在 2014 年年末调整的比较充分，估值合理，我们的配置由大蓝筹板块开始偏向环保、医药、TMT、新能源产业链、精细化工等成长类型的股票，保留了保险、地产（创新园区类）的行业配置。

5 月份前后，投资组合里开始增加低估值股票的权重，例如保险、食品饮料、家具、基础化工及银行，减持了部分涨幅较大，PEG 过高的股票。

在今年上半年市场大幅调整之前，我们始终将仓位保持在 85%-95% 的较高水平，6 月份之后主要依靠低估值股票缓冲了组合调整的幅度，并通过大比例分红的方式保护投资者的利益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2015 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值 1.504 元（累计净值 1.784 元）。报告期内本基金 A 类净值增长率为 65.69%，高于业绩比较基准 46.55 个百分点。截止 2015 年 6 月 30 日，本基金 C 类份额净值 1.491 元（累计净值 1.764 元）。报告期内本基金 C 类净值增长率为 63.76%，高于业绩比较基准 44.62 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年政策环境和上半年相比出现了明显的变化。货币政策边际上的宽松力度在减弱，财政

政策更为积极。经济层面来看，房地产和汽车等销售情况出现了走弱的迹象，出口短期内也很难形成正向的拉力，经济下滑的压力可能主要靠扩大基础设施建设来对冲，稳增长预期比上半年更为强烈。

6 月份，股票市场调整的速度和幅度在历史上来看都是罕见的，绝对收益户止损、杠杆资金降杠杆、基金赎回压力将持续。市场平稳后，市场的风格预期会发生切换，低估值、流动性好的大盘股票可能获得流动性溢价。行业上，我们相对看好银行、保险、食品饮料、建筑装饰、环保、医药、新能源汽车、农林牧渔等行业。主题投资上，我们相对看好迪士尼、京津冀、创新园区、冬奥会、工业 4.0 概念。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并设立估值委员会具体负责监督执行。估值委员会的成员由首席投资官、首席运营官、研究部总监、监察稽核部总监、清算登记部总监和基金会计主管组成。估值委员会负责组织制定、评估和适时修订基金估值政策和程序，并指导和监督整个估值流程。估值委员会成员包括基金核算、行业研究等方面的业务骨干，均具有基金从业资格、专业胜任能力和丰富的工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债数据估值服务；本基金与中证指数有限公司根据《中证债券估值数据服务协议》而取得中证数据估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，基金管理人于 2015 年 4 月 7 日发布公告，以 2015 年 3 月 31 日可分配利润为基准，每 10 份 A 类基金份额派发红利 2.8 元，每 10 份 C 类基金份额派发红利 2.73 元，符合相关法律法规及基金合同、招募说明书的有关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对圆信永丰双利证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，圆信永丰双利证券投资基金的管理人——圆信永丰基金管理有限公司在圆信永丰双利证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，圆信永丰双利证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 192,987,350.00 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对圆信永丰基金管理有限公司编制和披露的圆信永丰双利证券投资基金 2015 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|-----|-----|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 银行存款 | | 97,321,430.59 | 61,014,103.47 |
| 结算备付金 | | 5,832,917.79 | 11,776,902.94 |
| 存出保证金 | | 813,683.03 | 162,256.22 |
| 交易性金融资产 | | 723,000,256.55 | 955,999,104.52 |
| 其中：股票投资 | | 672,930,207.65 | 758,263,355.08 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 50,070,048.90 | 197,735,749.44 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | 69,228,955.58 | 34,107,968.52 |
| 应收利息 | | 1,448,515.43 | 1,466,984.49 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 2,068,253.27 | 1,847,597.15 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 899,714,012.24 | 1,066,374,917.31 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | 20,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 66,693,532.70 | 47,128,449.93 |
| 应付管理人报酬 | | 1,288,327.28 | 1,335,515.85 |
| 应付托管费 | | 214,721.21 | 222,585.92 |
| 应付销售服务费 | | 229,738.00 | 98,963.53 |
| 应付交易费用 | | 3,445,622.41 | 2,409,088.48 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | 13,946.22 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 158,701.23 | 72,220.57 |
| 负债合计 | | 72,030,642.83 | 71,280,770.50 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 552,134,156.28 | 901,703,938.57 |
| 未分配利润 | | 275,549,213.13 | 93,390,208.24 |
| 所有者权益合计 | | 827,683,369.41 | 995,094,146.81 |
| 负债和所有者权益总计 | | 899,714,012.24 | 1,066,374,917.31 |

6.2 利润表

会计主体：圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|-----|--|---|
| 一、收入 | | 398,571,506.74 | - |
| 1.利息收入 | | 938,764.84 | - |
| 其中：存款利息收入 | | 265,736.87 | - |
| 债券利息收入 | | 670,722.42 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,305.55 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 442,356,364.00 | - |
| 其中：股票投资收益 | | 419,699,528.84 | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 19,487,418.44 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 3,169,416.72 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | -50,839,110.84 | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | 6,115,488.74 | - |
| 减：二、费用 | | 18,335,292.19 | - |
| 1. 管理人报酬 | | 6,029,208.50 | - |
| 2. 托管费 | | 1,004,868.08 | - |
| 3. 销售服务费 | | 786,652.84 | - |
| 4. 交易费用 | | 10,397,127.10 | - |
| 5. 利息支出 | | 25,426.34 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 25,426.34 | - |
| 6. 其他费用 | | 92,009.33 | - |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 380,236,214.55 | - |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 380,236,214.55 | - |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|-----------------|-------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 901,703,938.57 | 93,390,208.24 | 995,094,146.81 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 380,236,214.55 | 380,236,214.55 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -349,569,782.29 | -5,089,859.66 | -354,659,641.95 |
| 其中：1.基金申购款 | 784,715,135.75 | 348,032,723.24 | 1,132,747,858.99 |
| 2.基金赎回款 | -1,134,284,918.04 | -353,122,582.90 | -1,487,407,500.94 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -192,987,350.00 | -192,987,350.00 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 552,134,156.28 | 275,549,213.13 | 827,683,369.41 |
| 项目 | 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | - | - | - |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | - | - |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |

| | | | |
|--|---|---|---|
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | - | - | - |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|----------|-----------|---------|
| 董晓亮 | 崔晓妮 | 虞俏依 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014] 928 号《关于核准圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由圆信永丰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,027,978,397.62 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 683 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,028,182,938.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 204,540.74 份基金份额。本基金的基金管理人为圆信永丰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额，称为 A 类基金份额；从该类基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用的一类基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（含中期票据、可转换债券、

中小企业私募债)、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)投资比例为基金资产的 0—95%,其中投资于本基金所定义的双红利主题类的股票资产及债券资产合计占比不低于非现金基金资产的 80%;债券、权证、货币市场工具和资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%—100%,其中权证占基金资产净值的 0%—3%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本财务报表由本基金的基金管理人圆信永丰基金管理有限公司于 2015 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外,其

他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------------|---------------------|
| 圆信永丰基金管理有限公司（“圆信永丰基金公司”） | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 厦门国际信托有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 台湾永丰证券投资信托股份有限公司 | 基金管理人的股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1 关联方报酬

6.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| | 2015年1月1日至2015年6月30日 | 2014年1月1日至2014年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 6,029,208.50 | - |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,070,127.10 | - |

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2015年1月1日至2015年6月30日 | 2014年1月1日至2014年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,004,868.08 | - |

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.8.1.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | | |
|----------------|---------------------------------|------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 圆信永丰双利 A | 圆信永丰双利 C | 合计 |
| 圆信永丰基金公司 | - | 574,111.26 | 574,111.26 |
| 中国工商银行 | - | 137,808.50 | 137,808.50 |
| 合计 | - | 711,919.76 | 711,919.76 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 圆信永丰双利 A | 圆信永丰双利 C | 合计 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给圆信永丰基金公司，再由圆信永丰基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值 × 0.8% / 当年天数。

6.4.8.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.8.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------|----------------------|----------------------|
| | 2015年1月1日至2015年6月30日 | 2014年1月1日至2014年6月30日 |

| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
|--------|---------------|------------|------|--------|
| 中国工商银行 | 97,321,430.59 | 188,735.28 | - | - |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.6 其他关联交易事项的说明

报告期及上年度可比期间本基金无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.10.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-----------------|----------------|--------|-------|--------|--------------|----------|----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 300487 | 蓝晓科技 | 2015 年 6 月 24 日 | 2015 年 7 月 2 日 | 新股流通受限 | 14.83 | 14.83 | 500 | 7,415.00 | 7,415.00 | - |

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|----------------|-----------|--------|------|-------|-----------|---------------|---------------|----|
| 002367 | 康力电梯 | 2015 年 6 月 2 日 | 筹划非公开发行事项 | 20.90 | - | - | 1,080,000 | 18,371,558.52 | 22,572,000.00 | - |

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 574,863,493.68 元，属于第二层次的余额为 148,136,762.87 元，无属于第三层次的余额。于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 27 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 6.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 672,930,207.65 | 74.79 |
| | 其中：股票 | 672,930,207.65 | 74.79 |
| 2 | 固定收益投资 | 50,070,048.90 | 5.57 |
| | 其中：债券 | 50,070,048.90 | 5.57 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 103,154,348.38 | 11.47 |
| 7 | 其他各项资产 | 73,559,407.31 | 8.18 |
| 8 | 合计 | 899,714,012.24 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 17,634,400.00 | 2.13 |
| B | 采矿业 | 4,692,800.00 | 0.57 |
| C | 制造业 | 439,981,841.25 | 53.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 2,255,200.00 | 0.27 |
| F | 批发和零售业 | 40,574,000.00 | 4.90 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 22,103,666.40 | 2.67 |
| J | 金融业 | 107,716,500.00 | 13.01 |
| K | 房地产业 | 26,910,000.00 | 3.25 |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | 11,061,800.00 | 1.34 |
| | 合计 | 672,930,207.65 | 81.30 |

7.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 002572 | 索菲亚 | 1,881,069 | 75,487,298.97 | 9.12 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 918,000 | 75,220,920.00 | 9.09 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 220,000 | 56,683,000.00 | 6.85 |
| 4 | 000513 | 丽珠集团 | 630,816 | 42,788,249.28 | 5.17 |
| 5 | 300088 | 长信科技 | 1,080,000 | 29,700,000.00 | 3.59 |
| 6 | 600064 | 南京高科 | 1,380,000 | 26,910,000.00 | 3.25 |
| 7 | 600016 | 民生银行 | 2,680,000 | 26,639,200.00 | 3.22 |
| 8 | 600436 | 片仔癀 | 380,000 | 25,334,600.00 | 3.06 |
| 9 | 600597 | 光明乳业 | 1,080,898 | 24,860,654.00 | 3.00 |
| 10 | 002658 | 雪迪龙 | 880,000 | 22,792,000.00 | 2.75 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 600340 | 华夏幸福 | 93,844,308.84 | 9.43 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 86,059,869.35 | 8.65 |
| 3 | 600064 | 南京高科 | 83,504,222.74 | 8.39 |
| 4 | 601601 | 中国太保 | 82,625,481.88 | 8.30 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 78,398,863.80 | 7.88 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 6 | 000555 | 神州信息 | 73,332,116.00 | 7.37 |
| 7 | 600120 | 浙江东方 | 72,309,930.42 | 7.27 |
| 8 | 002439 | 启明星辰 | 71,158,209.59 | 7.15 |
| 9 | 600436 | 片仔癀 | 70,313,250.12 | 7.07 |
| 10 | 002572 | 索菲亚 | 67,651,669.38 | 6.80 |
| 11 | 600109 | 国金证券 | 61,973,458.27 | 6.23 |
| 12 | 600895 | 张江高科 | 56,789,368.70 | 5.71 |
| 13 | 002603 | 以岭药业 | 55,030,930.03 | 5.53 |
| 14 | 002454 | 松芝股份 | 53,001,699.92 | 5.33 |
| 15 | 000800 | 一汽轿车 | 49,918,140.90 | 5.02 |
| 16 | 600410 | 华胜天成 | 49,267,394.84 | 4.95 |
| 17 | 000513 | 丽珠集团 | 49,115,882.24 | 4.94 |
| 18 | 601166 | 兴业银行 | 49,014,750.74 | 4.93 |
| 19 | 002658 | 雪迪龙 | 47,021,836.72 | 4.73 |
| 20 | 603899 | 晨光文具 | 46,448,147.38 | 4.67 |
| 21 | 300398 | 飞凯材料 | 44,148,054.96 | 4.44 |
| 22 | 600690 | 青岛海尔 | 41,819,669.42 | 4.20 |
| 23 | 601222 | 林洋电子 | 41,628,719.87 | 4.18 |
| 24 | 600606 | 金丰投资 | 38,970,302.72 | 3.92 |
| 25 | 002299 | 圣农发展 | 37,300,218.54 | 3.75 |
| 26 | 600278 | 东方创业 | 35,991,823.31 | 3.62 |
| 27 | 002563 | 森马服饰 | 35,136,651.15 | 3.53 |
| 28 | 002551 | 尚荣医疗 | 34,999,020.50 | 3.52 |
| 29 | 603456 | 九洲药业 | 34,860,134.53 | 3.50 |
| 30 | 000002 | 万科A | 34,298,642.87 | 3.45 |
| 31 | 600369 | 西南证券 | 32,635,144.60 | 3.28 |
| 32 | 002242 | 九阳股份 | 32,323,089.91 | 3.25 |
| 33 | 300147 | 香雪制药 | 32,006,313.11 | 3.22 |
| 34 | 600309 | 万华化学 | 29,793,559.48 | 2.99 |
| 35 | 600036 | 招商银行 | 29,690,678.27 | 2.98 |
| 36 | 600089 | 特变电工 | 28,763,504.04 | 2.89 |
| 37 | 000876 | 新希望 | 28,336,643.90 | 2.85 |
| 38 | 002007 | 华兰生物 | 27,966,150.02 | 2.81 |
| 39 | 000401 | 冀东水泥 | 27,108,322.50 | 2.72 |
| 40 | 002594 | 比亚迪 | 26,886,252.15 | 2.70 |
| 41 | 600016 | 民生银行 | 25,452,214.39 | 2.56 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 42 | 600597 | 光明乳业 | 25,338,904.01 | 2.55 |
| 43 | 600835 | 上海机电 | 24,843,351.88 | 2.50 |
| 44 | 600549 | 厦门钨业 | 24,435,459.43 | 2.46 |
| 45 | 002048 | 宁波华翔 | 23,572,266.28 | 2.37 |
| 46 | 002405 | 四维图新 | 23,350,001.70 | 2.35 |
| 47 | 000069 | 华侨城 A | 22,768,242.81 | 2.29 |
| 48 | 600352 | 浙江龙盛 | 22,639,428.85 | 2.28 |
| 49 | 002236 | 大华股份 | 22,631,995.53 | 2.27 |
| 50 | 600837 | 海通证券 | 22,085,080.95 | 2.22 |
| 51 | 600467 | 好当家 | 21,699,877.90 | 2.18 |
| 52 | 002653 | 海思科 | 21,683,737.30 | 2.18 |
| 53 | 002367 | 康力电梯 | 21,664,160.00 | 2.18 |
| 54 | 600887 | 伊利股份 | 21,542,898.54 | 2.16 |
| 55 | 600900 | 长江电力 | 21,537,285.68 | 2.16 |
| 56 | 000970 | 中科三环 | 21,436,423.94 | 2.15 |
| 57 | 300088 | 长信科技 | 21,111,963.85 | 2.12 |
| 58 | 600185 | 格力地产 | 20,752,590.30 | 2.09 |
| 59 | 002521 | 齐峰新材 | 20,395,295.33 | 2.05 |
| 60 | 600138 | 中青旅 | 19,932,527.94 | 2.00 |

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1 | 600895 | 张江高科 | 138,204,904.10 | 13.89 |
| 2 | 600120 | 浙江东方 | 120,315,328.15 | 12.09 |
| 3 | 600340 | 华夏幸福 | 118,546,957.66 | 11.91 |
| 4 | 601601 | 中国太保 | 112,367,178.00 | 11.29 |
| 5 | 002439 | 启明星辰 | 99,944,415.73 | 10.04 |
| 6 | 601222 | 林洋电子 | 91,195,173.99 | 9.16 |
| 7 | 002603 | 以岭药业 | 76,727,740.35 | 7.71 |
| 8 | 600064 | 南京高科 | 73,872,611.07 | 7.42 |
| 9 | 600436 | 片仔癀 | 72,549,509.23 | 7.29 |
| 10 | 600109 | 国金证券 | 71,019,873.91 | 7.14 |
| 11 | 002658 | 雪迪龙 | 70,793,767.27 | 7.11 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 12 | 600036 | 招商银行 | 64,163,379.30 | 6.45 |
| 13 | 300398 | 飞凯材料 | 58,431,853.19 | 5.87 |
| 14 | 000555 | 神州信息 | 58,030,730.69 | 5.83 |
| 15 | 600410 | 华胜天成 | 57,689,403.20 | 5.80 |
| 16 | 600597 | 光明乳业 | 56,508,107.57 | 5.68 |
| 17 | 601318 | 中国平安 | 56,406,005.47 | 5.67 |
| 18 | 601328 | 交通银行 | 55,617,784.95 | 5.59 |
| 19 | 000401 | 冀东水泥 | 51,488,316.33 | 5.17 |
| 20 | 601166 | 兴业银行 | 48,455,169.00 | 4.87 |
| 21 | 601988 | 中国银行 | 47,315,400.00 | 4.75 |
| 22 | 600519 | 贵州茅台 | 46,114,621.60 | 4.63 |
| 23 | 600079 | 人福医药 | 45,592,787.91 | 4.58 |
| 24 | 600690 | 青岛海尔 | 44,464,430.55 | 4.47 |
| 25 | 000800 | 一汽轿车 | 44,453,207.61 | 4.47 |
| 26 | 300088 | 长信科技 | 43,791,004.12 | 4.40 |
| 27 | 000858 | 五粮液 | 43,290,688.05 | 4.35 |
| 28 | 603456 | 九洲药业 | 41,519,151.31 | 4.17 |
| 29 | 600606 | 金丰投资 | 41,503,547.36 | 4.17 |
| 30 | 002299 | 圣农发展 | 40,980,346.15 | 4.12 |
| 31 | 600511 | 国药股份 | 39,773,512.64 | 4.00 |
| 32 | 002551 | 尚荣医疗 | 39,749,857.60 | 3.99 |
| 33 | 603899 | 晨光文具 | 38,354,895.61 | 3.85 |
| 34 | 300147 | 香雪制药 | 37,505,015.84 | 3.77 |
| 35 | 002242 | 九阳股份 | 36,039,092.64 | 3.62 |
| 36 | 002454 | 松芝股份 | 34,602,062.91 | 3.48 |
| 37 | 600369 | 西南证券 | 33,947,035.50 | 3.41 |
| 38 | 000002 | 万科A | 33,578,350.89 | 3.37 |
| 39 | 600309 | 万华化学 | 33,460,629.82 | 3.36 |
| 40 | 000902 | 新洋丰 | 33,332,157.56 | 3.35 |
| 41 | 000876 | 新希望 | 30,474,547.22 | 3.06 |
| 42 | 000997 | 新大陆 | 30,237,895.95 | 3.04 |
| 43 | 600048 | 保利地产 | 28,945,551.50 | 2.91 |
| 44 | 002405 | 四维图新 | 27,178,911.92 | 2.73 |
| 45 | 600887 | 伊利股份 | 27,136,975.62 | 2.73 |
| 46 | 000069 | 华侨城A | 26,822,532.00 | 2.70 |
| 47 | 600900 | 长江电力 | 26,419,451.46 | 2.65 |
| 48 | 002563 | 森马服饰 | 26,338,617.69 | 2.65 |
| 49 | 600089 | 特变电工 | 26,195,885.53 | 2.63 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 50 | 600837 | 海通证券 | 26,032,281.90 | 2.62 |
| 51 | 002236 | 大华股份 | 25,265,857.15 | 2.54 |
| 52 | 600009 | 上海机场 | 24,781,188.14 | 2.49 |
| 53 | 600352 | 浙江龙盛 | 23,918,192.72 | 2.40 |
| 54 | 600976 | 健民集团 | 23,686,830.25 | 2.38 |
| 55 | 000970 | 中科三环 | 23,098,793.80 | 2.32 |
| 56 | 002007 | 华兰生物 | 22,960,629.17 | 2.31 |
| 57 | 600185 | 格力地产 | 22,255,228.41 | 2.24 |
| 58 | 002521 | 齐峰新材 | 20,948,981.97 | 2.11 |
| 59 | 600486 | 扬农化工 | 20,570,550.00 | 2.07 |

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 3,145,424,306.52 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,610,138,812.80 |

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 50,070,048.90 | 6.05 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 50,070,048.90 | 6.05 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019414 | 14 国债 14 | 274,590 | 27,469,983.60 | 3.32 |
| 2 | 019321 | 13 国债 21 | 170,100 | 17,106,957.00 | 2.07 |
| 3 | 020075 | 15 贴债 01 | 50,000 | 4,939,500.00 | 0.60 |
| 4 | 019028 | 10 国债 28 | 5,530 | 553,608.30 | 0.07 |

7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 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交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 813,683.03 |
| 2 | 应收证券清算款 | 69,228,955.58 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,448,515.43 |
| 5 | 应收申购款 | 2,068,253.27 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 73,559,407.31 |

7.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.4 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额 级别 | 持有人 户数 | 户均持有的基 金份额 | 持有人结构 | |
|----------|-----------|---------------|-------|-------|
| | | | 机构投资者 | 个人投资者 |
| | | | | |

| | (户) | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
|----------|-------|--------------|----------------|--------|----------------|--------|
| 圆信永丰双利 A | 5,446 | 64,958.45 | 10,881,998.38 | 3.08% | 342,881,747.38 | 96.92% |
| 圆信永丰双利 C | 32 | 6,199,075.33 | 162,124,880.48 | 81.73% | 36,245,530.04 | 18.27% |
| 合计 | 5,478 | 100,791.19 | 173,006,878.86 | 31.33% | 379,127,277.42 | 68.67% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|----------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 圆信永丰双利 A | 1,434,293.99 | 0.4054% |
| | 圆信永丰双利 C | 4,977,937.19 | 2.5094% |
| | 合计 | 6,412,231.18 | 1.1614% |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|------------------------------|----------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 圆信永丰双利 A | 10~50 |
| | 圆信永丰双利 C | >100 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 圆信永丰双利 A | 0~10 |
| | 圆信永丰双利 C | >100 |
| | 合计 | >100 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 圆信永丰双利 A | 圆信永丰双利 C |
|----|----------|----------|
|----|----------|----------|

| | | |
|---------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2014 年 11 月 19 日）基金份额总额 | 871,615,190.36 | 156,567,748.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 809,588,208.39 | 92,115,730.18 |
| 本报告期基金总申购份额 | 547,559,913.58 | 237,155,222.17 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,003,384,376.21 | 130,900,541.83 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 353,763,745.76 | 198,370,410.52 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人原总经理周昭如女士离职，公司副总经理、上海分公司负责人董晓亮先生主持工作。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 兴业证券 | 2 | 2,111,442,991.49 | 31.26% | 1,922,256.57 | 31.75% | - |
| 招商证券 | 2 | 941,167,460.94 | 13.93% | 856,839.36 | 14.15% | - |
| 安信证券 | 2 | 905,278,828.97 | 13.40% | 824,165.16 | 13.61% | - |
| 海通证券 | 2 | 575,728,456.28 | 8.52% | 524,142.29 | 8.66% | - |
| 国泰君安 | 2 | 567,196,326.75 | 8.40% | 516,376.93 | 8.53% | - |
| 中金公司 | 2 | 540,175,187.43 | 8.00% | 491,775.85 | 8.12% | - |
| 东方证券 | 2 | 479,139,331.24 | 7.09% | 340,380.64 | 5.62% | - |
| 中信建投 | 2 | 338,841,494.80 | 5.02% | 308,481.29 | 5.10% | - |
| 中信证券 | 2 | 296,129,986.42 | 4.38% | 269,596.39 | 4.45% | - |

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|----------------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 兴业证券 | 107,666,455.88 | 46.82% | 41,000,000.00 | 73.21% | - | - |
| 招商证券 | 10,151,730.70 | 4.41% | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 77,021,738.50 | 33.49% | 5,000,000.00 | 8.93% | - | - |
| 国泰君安 | 21,705,790.75 | 9.44% | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|--------------|-------|---------------|--------|---|---|
| 东方证券 | 5,025,993.08 | 2.19% | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | 10,000,000.00 | 17.86% | - | - |
| 中信证券 | 8,410,500.00 | 3.66% | - | - | - | - |

注：1. 本报告期内基金新增 10 个证券公司交易单元，分别为招商证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，安信证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，东方证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，中信建投证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，国泰君安证券股份有限公司上交所及深交所交易单元。

2. 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。选择租用证券公司基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 资金实力雄厚，财务状况良好；
- (2) 经营行为稳健文件规范，在业内有良好的声誉；
- (3) 内控制度健全，内部管理严格；，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行交易的需要；并能为基金提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员；
- (6) 具备较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较强的研究综合实力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、策略、行业、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；合作机构研究强项与我司研究重点匹配度高，能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他业务的开展提供良好的服务和支持。

3. 基金选择证券公司交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后，确定拟选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 本基金管理人与和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

圆信永丰基金管理有限公司
2015 年 8 月 26 日