

# 圆信永丰兴融债券型证券投资基金 2016 年 年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 日

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

送出日期：2017 年 3 月 31 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告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及其更新。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止及 2015 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |              |
|-----------------|--------------------|--------------|
| 基金简称            | 圆信永丰兴融             |              |
| 基金主代码           | 002073             |              |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |              |
| 基金合同生效日         | 2015 年 12 月 21 日   |              |
| 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         |              |
| 报告期末基金份额总额      | 2,460,312,783.64 份 |              |
| 基金合同存续期         | 不定期                |              |
| 下属分级基金的基金简称:    | 圆信永丰兴融 A           | 圆信永丰兴融 C     |
| 下属分级基金的交易代码:    | 002073             | 002074       |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,460,125,780.03 份 | 187,003.61 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 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，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，并在此基础上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 中国债券综合全价指数。  |
| 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。   |

### 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           | 兴业银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 吕富强                    | 张志永                 |
|         | 联系电话 | 021-60366000           | 021-62677777-212004 |
|         | 电子邮箱 | service@gtsfund.com.cn | zhangzhy@cib.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 4006070088             | 95561               |
| 传真      |      | 021-60366006           | 021-62159217        |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                    |
|---------------------|--------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.gtsfund.com.cn |
|---------------------|--------------------|

|            |                                   |
|------------|-----------------------------------|
| 基金年度报告备置地点 | 上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦<br>19 楼 |
|------------|-----------------------------------|

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2016 年           |            | 2015 年 12 月 21 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日 |            |
|---------------|------------------|------------|--|------------|
|               | 圆信永丰兴融 A         | 圆信永丰兴融 C   | 圆信永丰兴融 A                                   | 圆信永丰兴融 C   |
| 本期已实现收益       | 77,176,956.02    | 32,137.00  | 126,900.28                                 | 272.03     |
| 本期利润          | 19,859,456.29    | 14,047.23  | 126,900.28                                 | 272.03     |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0124           | 0.0196     | 0.0006                                     | 0.0005     |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.30%            | 2.20%      | 0.10%                                      | 0.10%      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末          |            | 2015 年末                                    |            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0244           | 0.0225     | 0.0006                                     | 0.0005     |
| 期末基金资产净值      | 2,520,161,461.81 | 191,216.88 | 200,530,393.47                             | 519,883.74 |
| 期末基金份额净值      | 1.024            | 1.023      | 1.001                                      | 1.001      |

#### 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

圆信永丰兴融 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月      | -1.82%   | 0.14%       | -2.32%     | 0.15%         | 0.50% | -0.01% |
| 过去六个月      | 0.79%    | 0.12%       | -1.42%     | 0.11%         | 2.21% | 0.01%  |
| 过去一年       | 2.30%    | 0.10%       | -1.63%     | 0.09%         | 3.93% | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 2.40%    | 0.10%       | -1.06%     | 0.09%         | 3.46% | 0.01%  |

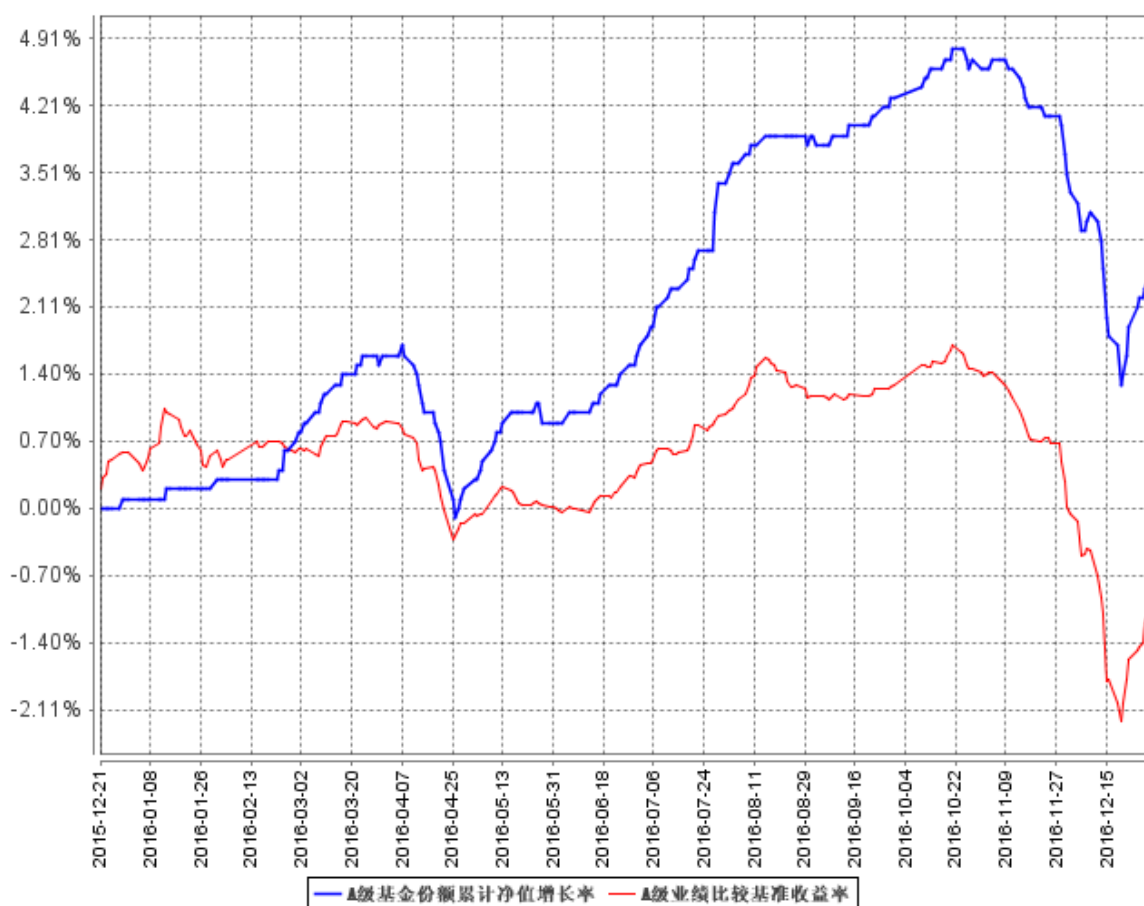
圆信永丰兴融 C

| 阶段 | 份额净值增 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较基准 | ①-③ | ②-④ |
|----|-------|------|------|--------|-----|-----|
|----|-------|------|------|--------|-----|-----|

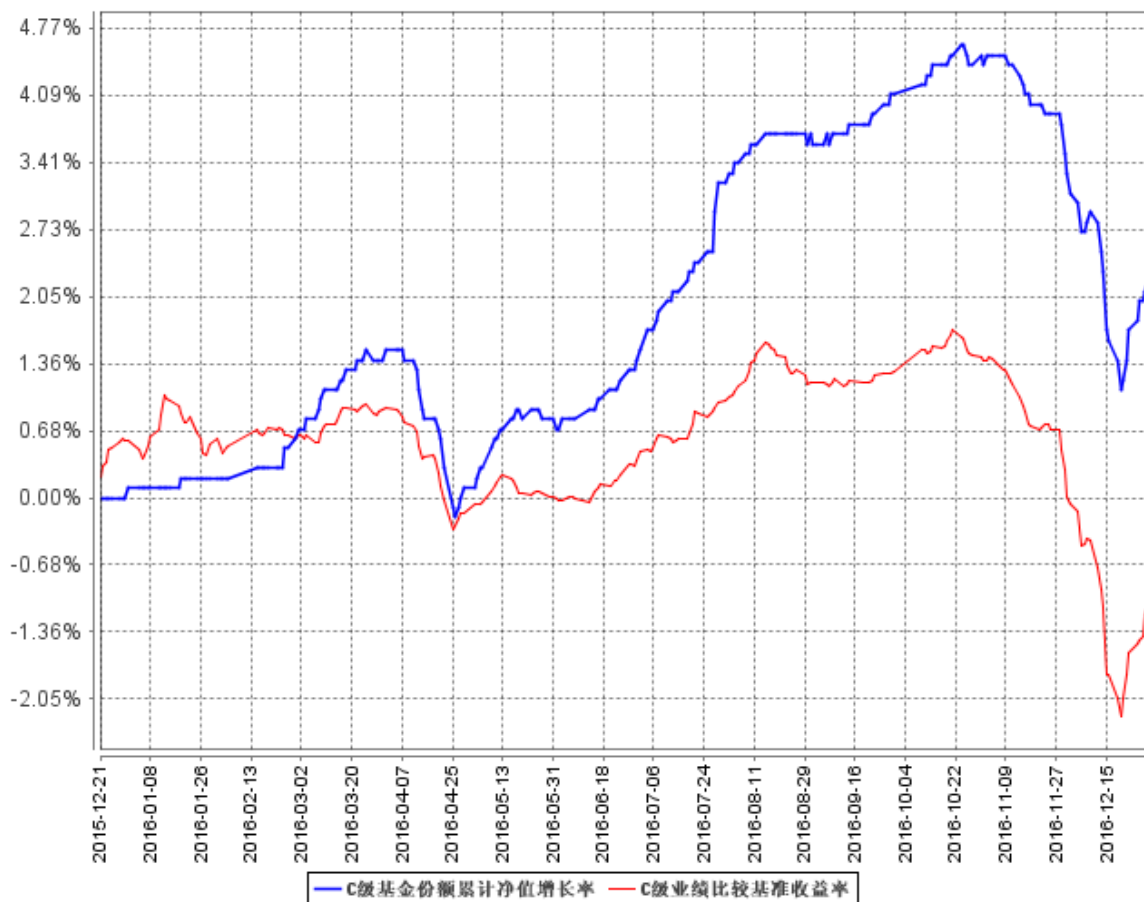
|                | 长率①    | 增长率标准<br>差② | 基准收益<br>率③ | 收益率标准<br>差④ |       |        |
|----------------|--------|-------------|------------|-------------|-------|--------|
| 过去三个月          | -1.73% | 0.14%       | -2.32%     | 0.15%       | 0.59% | -0.01% |
| 过去六个月          | 0.89%  | 0.12%       | -1.42%     | 0.11%       | 2.31% | 0.01%  |
| 过去一年           | 2.20%  | 0.10%       | -1.63%     | 0.09%       | 3.83% | 0.01%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 2.30%  | 0.10%       | -1.06%     | 0.09%       | 3.36% | 0.01%  |

### 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

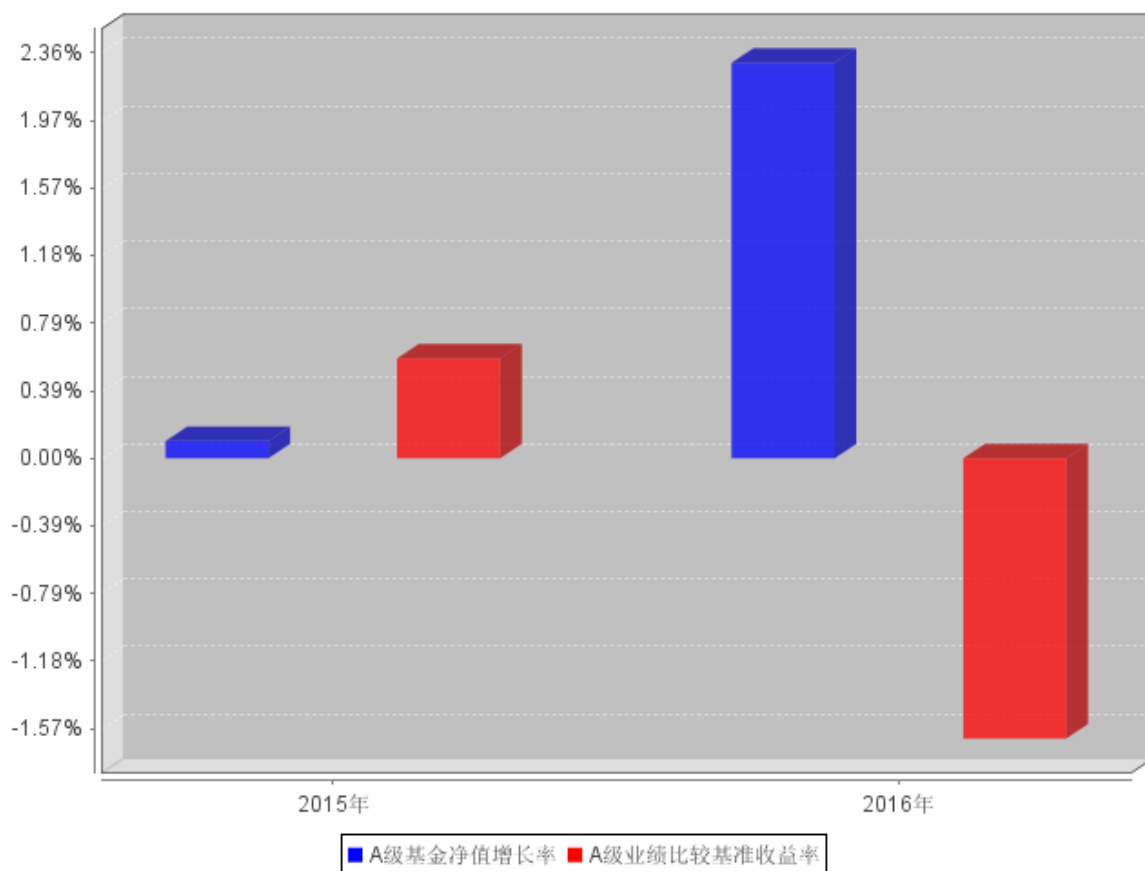


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

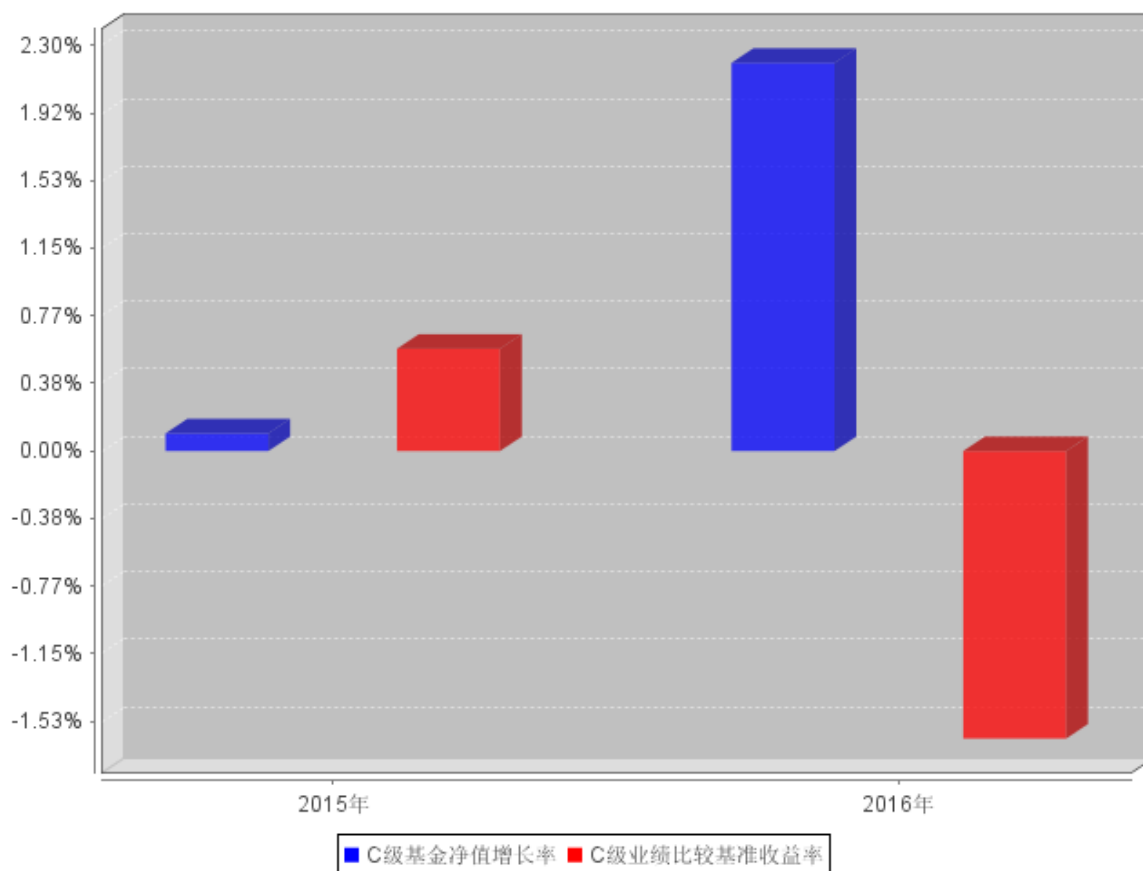


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

### A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2016 年 2 月 23 日成立，截止报告期末，本基金成立不满一年。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：截止 2016 年末，本基金未进行利润分配。

## § 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 2016 年 12 月 31 日，公司旗下管理六只开放式基金产品，包括一只股票型基金、一只混合型基金和四只债券型基金。



#### 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 |        |  |
| 许燕 | 本基金基金经理 | 2015 年 12 月 21 日 | -    | 7 年    | 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固定收益投资部总监助理。历任上海新世纪资信评估投资服务有限公司信用分析师，鹏元资信评估有限公司信用分析师，圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设固定收益投资部基金经理。 |
| 林铮 | 本基金基金经理 | 2016 年 4 月 11 日  | -    | 8 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定收益投资部副总监。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。               |

#### 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，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《圆信永丰兴融债券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 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求，制订了《圆信永丰基金管理有限公司公平交易管理办法》，规范公司旗下所有投资组合参与股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，同时贯穿了投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

公司执行自上而下的三级授权体系，依次为公募基金投资决策委员会、首席投资官、基金经理，基金经理在其授权范围内自主决策，公募基金投资决策委员会和首席投资官均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立科学客观的研究方法，同享研究资源和投资备选库为投资人员提供公平的投资机会，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动，不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易室询价机制，严格防范交易对手风险并抽检价格公允性；对于一级市场申购投资行为，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。

公司制订了《圆信永丰基金管理有限公司异常交易监控管理办法》，通过系统和人工、定量和定性相结合的方式进行投资交易行为的监控分析，并执行异常交易行为监控分析记录工作机制，确保公平交易可稽核。公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查，持续督促公平交易制度的落实执行并在实践中不断检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行上述公平交易制度和控制方法，开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的整体收益率差异、以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析，对以公司名义进行的一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控等，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中，在同向交易的监控和分析方面，根据法规要求，公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控，通过定期抽查前述的同向交易行为，定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势，重点关注任何可能导致不公平交易的情形。对于识别的异常情况，由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时，公司根据法规的要求，通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗内（T=1 日、T=3 日、T=5 日）的同向交易价差进行分析，采用概率统计方法，重点关注不同投资组合之间同向交易溢价率均值是否为零的 t 检验，以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。在一级市场证券申购和分配方面，事前对申购指令单进行审核监控，事后对以公司名义进行的申购报价单进行核查，确保分配结果符合公平交易的原则。

报告期内，通过前述分析方法，未发现公司旗下不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

### 4.3.3 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

2016 年部分热点城市房价出现较快上涨，中央和多个地方出台房地产限贷限购政策防止持续过热，一二线成交量已开始有所降温，基建投资仍维持较快增速，中游企业延续补库存生产活动，经济仍处于相对平稳运行阶段；物价方面，CPI 逐渐反弹回到 2% 以上水平，大宗商品持续反弹，带动 PPI 同比转正并持续向上攀升；央行通过 MLF 和公开市场投放资金，并延长投放资金期限，银行间资金成本显著抬升，10 月末后资金面持续趋紧，引发银行间流动性波动压力。央行试行将表外理财纳入商业银行 MPA 考核，未来表外理财增速也可能受到一定限制。海外主要国家经济逐步回暖，利率普遍上行，中国债券市场在持续了近三年的牛市后开始走弱，利率债收益率显著上行并普遍超出年初水平，信用债市场收益率伴随市场流动性压力加大也持续调整，信用债的利差普遍有所扩大。

投资策略上，随着债券市场的调整以及政策的一些变化，本基金采取了部分防守措施，包括降低杠杆比例，改善组合风险收益比并提升流动性。目前组合中主要配置中高等级信用债。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2016 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值：1.024 元（累计净值：1.024 元），报告期内净值增长率：2.30%，高于业绩比较基准 3.93%；C 类份额净值：1.023 元（累计净值：1.023 元），报告期内净值增长率：2.20%，高于业绩比较基准 3.83%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年：海外方面，美国特朗普总统上台后美国财政刺激多大程度上能实现仍有待后期观察，未来仍有进一步加息空间。国内方面，2017 年实际经济增长目标面临进一步下调压力。基建继续是稳定经济的中坚力量，但受制于地方级中央财政收入下滑及赤字率约束，传统积极财政政策空间较为有限，未来基建增速难持续保持高位。房地产行业和金融业伴随着中央去杠杆和挤泡沫政策导向，未来一段时间内对经济总量仍有一定拖累影响，而居民信贷回落进一步降低社会融资及整体信贷增长。通胀方面，2017 年国内物价或呈现温和上涨态势，预计 2017 年 CPI 均值可能

在 2%以上,但还不会形成高通胀。供给端冲击下,PPI 中枢将有所走高,PPI 均值可能会抬升 3%-4%。货币政策方面,中央经济工作会议指出 2017 年继续实施积极财政政策和稳健货币政策,货币政策保持稳健中性,调节好货币闸门。信用风险方面,过剩产能企业在经济下行的过程中仍然面临较大的经营风险和偿债压力,信用风险事件仍将出现,但工业企业利润已有所改善,爆发大规模违约事件的可能性较小。

本基金 2017 年将紧跟宏观基本面与货币政策的走向,暂先维持较低杠杆,随着基本面下行带来的趋势性机会出现,将适度调整持仓并加大持仓杠杆,提升整体组合收益。本基金将维持中高等级的信用筛选原则,并做好流动性风险防御措施。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年,证监会系统着力推进依法监管、从严监管、全面监管的理念,中国证监会领导提出了夯实发展基础、统一监管标准、推动资管行业持续健康发展的期望。基金管理人牢记“受人之托、代人理财”的初心,忠实履行“诚实守信、勤勉尽责”这一职业操守的底线。公司监察稽核工作以“提升合规服务、推进业务发展、保障稳健经营、提升内控水平、保障投资者合法权益”为总体目标,秉承以合规促进发展、以服务创造价值的理念,按照工作计划结合实际情况对公司各项业务进行全面的监察稽核工作,保障和促进公司各项业务合法合规运作。

报告期内,基金管理人内部监察稽核工作贯穿三条主线:

1. 紧抓员工行为、公平交易、利益冲突、营销规范等方面的日常监控,积极防范内幕交易,坚守合规底线不动摇。做好以事前防范为主的合规服务,积极避免合规风险;做好对高风险业务高频率的合规监控,及时发现合规风险。

2. 迎合监管政策变化,动态调整合规风控工作。报告期内,基金管理人进一步加大了针对投资风险、流动性风险的监督,并积极防范运营过程中的操作风险。针对风险控制的需求和重点,加强事前风险识别,强化事后稽核力度,提高工作水平。做好有重点的专项审计,针对性的发现内控薄弱环节。

3. 及时跟踪行业监管动向,发布更新监管动态,结合新法规实施、新监管要求落实以及公司业务发展的实际情况,充分利用外部专业机构的实务经验和专业优势,推动和完善公司相关制度流程的建立、健全,防范日常运作中的违规行为发生。提供多样化的合规培训,提高员工的合规意识;营造合规氛围,组织全员参与合规宣传活动。

报告期内,基金管理人各项业务运作正常,内部控制和风险防范措施不断完善并积极发挥作用。本基金运作合法合规,保障了基金份额持有人的利益。我们将继续以合规运作和风险管理为核心,提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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。基金经理不属于公司估值委员会成员，不介入基金日常估值业务。

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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 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

报告期内出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人情形，未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形。

### § 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的

监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2017)第 20211 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题       | 审计报告   |
|--------------|--|
| 审计报告收件人      | 圆信永丰兴融债券型证券投资基金全体基金份额持有人   |
| 引言段          | 我们审计了后附的圆信永丰兴融债券型证券投资基金(以下简称“圆信永丰兴融债券基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日和 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度和 2015 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。                                    |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是圆信永丰兴融债券基金的基金管理人圆信永丰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:<br>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;<br>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 |
| 注册会计师的责任段    | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。<br>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进     |

|           |   |
|-----------|---|
|           | 行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。<br>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。   |
| 审计意见段     | 我们认为，上述圆信永丰兴融债券基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了圆信永丰兴融债券基金 2016 年 12 月 31 日和 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度和 2015 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 注册会计师的姓名  | 单峰 陈迺迤  |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  |
| 会计师事务所的地址 | 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼   |
| 审计报告日期    | 2017 年 3 月 17 日   |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：圆信永丰兴融债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号 | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|-----|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |     |                         |                          |
| 银行存款       |     | 24,296,732.80           | 200,922,704.90           |
| 结算备付金      |     | 1,480,454.58            | -                        |
| 存出保证金      |     | -                       | -                        |
| 交易性金融资产    |     | 2,353,266,100.00        | -                        |
| 其中：股票投资    |     | -                       | -                        |
| 基金投资       |     | -                       | -                        |
| 债券投资       |     | 2,353,266,100.00        | -                        |
| 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   |     | 67,079,150.12           | -                        |
| 应收证券清算款    |     | 20,039,277.78           | -                        |
| 应收利息       |     | 55,531,323.25           | 161,765.38               |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | -                          | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            |            | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 2,521,693,038.53           | 201,084,470.28              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2015年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                            |                             |
| 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       |            | -                          | -                           |
| 应付证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 854,424.00                 | 22,025.21                   |
| 应付托管费           |            | 320,409.01                 | 8,259.45                    |
| 应付销售服务费         |            | 149.31                     | 56.98                       |
| 应付交易费用          |            | 6,377.52                   | -                           |
| 应交税费            |            | -                          | -                           |
| 应付利息            |            | -                          | -                           |
| 应付利润            |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            |            | 159,000.00                 | 3,851.43                    |
| 负债合计            |            | 1,340,359.84               | 34,193.07                   |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            |            | 2,460,312,783.64           | 200,923,104.90              |
| 未分配利润           |            | 60,039,895.05              | 127,172.31                  |
| 所有者权益合计         |            | 2,520,352,678.69           | 201,050,277.21              |
| 负债和所有者权益总计      |            | 2,521,693,038.53           | 201,084,470.28              |

注:

1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日, 圆信永丰兴融债券基金 A 类份额净值 1.024 元, 圆信永丰兴融债券基金 C 类份额净值 1.023 元, 圆信永丰兴融债券基金基金份额总额 2,460,312,783.64 份, 其中圆信永丰兴融债券基金 A 类份额 2,460,125,780.03 份, 圆信永丰兴融债券基金 C 类份额 187,003.61 份(2015 年 12 月 31 日, 圆信永丰兴融债券基金 A 类份额净值 1.001 元, 圆信永丰兴融债券基金 C 类份额净值 1.001 元, 圆信永丰兴融债券基金基金份额总额 200,923,104.90 份, 其中圆信永丰兴融债券基金 A 类份额 200,403,493.19 份, 圆信永丰兴融债券基金 C 类份额 519,611.71 份)。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年度和 2015 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。



## 7.2 利润表

会计主体：圆信永丰兴融债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号       | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 12 月 21 日(基<br>金合同生效日)至 2015<br>年 12 月 31 日 |
|----------------------------|-----------|---|---|
| <b>一、收入</b>                |           | 29,049,799.42                             | 161,765.38  |
| 1.利息收入                     |           | 84,908,275.33                             | 161,765.38  |
| 其中：存款利息收入                  |           | 625,072.96                                | 161,765.38  |
| 债券利息收入                     |           | 83,018,748.00                             | -   |
| 资产支持证券利息收入                 |           | 217,775.35                                | -   |
| 买入返售金融资产收入                 |           | 1,046,679.02                              | -   |
| 其他利息收入                     |           | -   | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |           | 1,474,359.04                              | -   |
| 其中：股票投资收益                  |           | -   | -   |
| 基金投资收益                     |           | -   | -   |
| 债券投资收益                     |           | 1,388,600.14                              | -   |
| 资产支持证券投资收益                 |           | 85,758.90                                 | -   |
| 贵金属投资收益                    |           | -   | -   |
| 衍生工具收益                     |           | -   | -   |
| 股利收益                       |           | -   | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      |           | -57,335,589.50                            | -   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |           | -   | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          |           | 2,754.55                                  | -   |
| <b>减：二、费用</b>              |           | 9,176,295.90                              | 34,593.07   |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.8.2.1 | 6,525,461.27                              | 22,025.21   |
| 2. 托管费                     | 7.4.8.2.2 | 2,447,047.91                              | 8,259.45  |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.8.2.3 | 2,925.91                                  | 56.98   |
| 4. 交易费用                    |           | 12,767.77                                 | -   |
| 5. 利息支出                    |           | 2,321.45                                  | -   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |           | 2,321.45                                  | -   |
| 6. 其他费用                    |           | 185,771.59                                | 4,251.43  |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |           | 19,873,503.52                             | 127,172.31  |
| 减：所得税费用                    |           | -   | -   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |           | 19,873,503.52                             | 127,172.31  |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：圆信永丰兴融债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）                        | 200,923,104.90   | 127,172.31    | 201,050,277.21   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -  | 19,873,503.52 | 19,873,503.52    |
| 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）      | 2,259,389,678.74                                       | 40,039,219.22 | 2,299,428,897.96 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 2,262,588,493.04                                       | 40,117,697.66 | 2,302,706,190.70 |
| 2. 基金赎回款                               | -3,198,814.30  | -78,478.44    | -3,277,292.74    |
| 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）                        | 2,460,312,783.64                                       | 60,039,895.05 | 2,520,352,678.69 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 12 月 21 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 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）                        | 200,923,104.90   | -             | 200,923,104.90   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -  | 127,172.31    | 127,172.31       |
| 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）                        | 200,923,104.90 | 127,172.31 | 201,050,277.21 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

董晓亮                                  于娟                                  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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

圆信永丰兴融债券型证券投资基金(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[2015]2507号《关于准予圆信永丰兴融债券型证券投资基金注册的批复》准予,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《圆信永丰兴融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200,923,088.10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(2015)第1442号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《圆信永丰兴融债券型证券投资基金基金合同》于2015年12月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,923,104.90份基金份额,其中认购资金利息折合16.80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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《圆信永丰兴融债券型证券投资基金基金合同》和《圆信永丰兴融债券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《圆信永丰兴融债券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债券、货币市场工具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相关规定)。本基金主要投资于国债、央行票据、金融债、次级债、政府机构债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括

协议存款、定期存款及其他银行存款)等固定收益类资产。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中国债券综合全价指数。

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 2017 年 3 月 17 日批准报出。

## 7.4.2 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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《圆信永丰兴融债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度和 2015 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日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 2016 年 12 月 31 日和 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度和 2015 年 12 月 21 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

-

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收

政策的通知》、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》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

(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。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                        | 与本基金的关系             |
|------------------------------|---------------------|
| 圆信永丰基金管理有限公司（以下简称“圆信永丰基金公司”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）       | 基金托管人、基金销售机构        |
| 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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易本基金

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 12 月 21 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|----------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 6,525,461.27                     | 22,025.21                                     |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 1,837.01                         | 31.80   |

注:支付基金管理人圆信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.40%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                                       |
|----------------|----------------------------------|---|
|                | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 12 月 21 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,447,047.91                     | 8,259.45                                      |

注:支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 7.4.8.2.3 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  |          |        |
|----------------|---|----------|--------|
|                | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日              |          |        |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                              |          |        |
|                | 圆信永丰兴融 A                                      | 圆信永丰兴融 C | 合计     |
| 圆信永丰基金公司       | -   | 169.64   | 169.64 |
| 兴业银行           | -   | -        | -      |
| 合计             | -   | 169.64   | 169.64 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                                       |          |        |
|                | 2015 年 12 月 21 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日 |          |        |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                              |          |        |
|                | 圆信永丰兴融 A                                      | 圆信永丰兴融 C | 合计     |
| 圆信永丰基金公司       | -   | 13.68    | 13.68  |

|      |   |       |       |
|------|---|-------|-------|
| 兴业银行 | - | -     | -     |
| 合计   | - | 13.68 | 13.68 |

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的约定年费率计提，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。A 类基金份额不从本类别基金资产中计提销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.4%。其计算公式为：

C 类基金份额日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.4% / 当年天数

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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

份额单位：份

| 圆信永丰兴融 A |                         |                          |                          |                          |
|----------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 关联方名称    | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |                          |
|          | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 兴业银行     | 2,459,945,916.55        | 99.9927%                 | 199,999,000.00           | 99.7982%                 |

#### 7.4.8.5 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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |            | 上年度可比期间<br>2015 年 12 月 21 日(基金合同生效日)<br>至 2015 年 12 月 31 日 |           |
|-------|--|------------|--|-----------|
|       | 期末余额                                   | 当期利息收入     | 期末余额   | 当期利息收入    |
| 兴业银行  | 24,296,732.80                          | 283,882.60 | 10,922,704.90  | 22,015.36 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末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。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末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。

#### 7.4.10 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 2016 年 12 月 31 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二层次的余额为 2,353,266,100.00 元，无属于第一层次以及第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：未持有金融资产)。

###### (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和债券，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和债券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,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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              | -                | -             |
|    | 其中:股票             | -                | -             |
| 2  | 固定收益投资            | 2,353,266,100.00 | 93.32         |
|    | 其中:债券             | 2,353,266,100.00 | 93.32         |
|    | 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          | 67,079,150.12    | 2.66          |
|    | 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      | 25,777,187.38    | 1.02          |
| 7  | 其他各项资产            | 75,570,601.03    | 3.00          |
| 8  | 合计                | 2,521,693,038.53 | 100.00        |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.2.2 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 8.3 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      | -                | -             |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 124,643,500.00   | 4.95          |
|    | 其中：政策性金融债 | 124,643,500.00   | 4.95          |
| 4  | 企业债券      | 1,601,618,600.00 | 63.55         |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -             |
| 6  | 中期票据      | 337,384,000.00   | 13.39         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -             |
| 8  | 同业存单      | 289,620,000.00   | 11.49         |
| 9  | 其他        | -                | -             |
| 10 | 合计        | 2,353,266,100.00 | 93.37         |

## 8.4 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  | 101652016 | 16 大连万达 MTN001 | 2,000,000 | 194,800,000.00 | 7.73          |
| 2  | 111604011 | 16 中行 CD011    | 2,000,000 | 193,020,000.00 | 7.66          |
| 3  | 1080181   | 10 南宁城投债       | 1,500,000 | 161,835,000.00 | 6.42          |
| 4  | 101554029 | 15 穗地铁 MTN001  | 1,200,000 | 122,052,000.00 | 4.84          |
| 5  | 1480244   | 14 渝保税港债       | 1,100,000 | 118,206,000.00 | 4.69          |

## 8.5 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。

**8.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.7 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。

**8.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.8.1 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交易。

**8.8.2 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。

**8.8.3 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。

**8.9 投资组合报告附注****8.9.1**

通过查阅中国证监会网站公开目录“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。

**8.9.2 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   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | 20,039,277.78 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 55,531,323.25 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 75,570,601.03 |

**8.9.3 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。

### 8.9.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 8.9.5 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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) | 户均持有的基金份额     | 持有人结构            |        |            |         |
|----------|----------|---------------|------------------|--------|------------|---------|
|          |          |               | 机构投资者            |        | 个人投资者      |         |
|          |          |               | 持有份额             | 占总份额比例 | 持有份额       | 占总份额比例  |
| 圆信永丰兴融 A | 130      | 18,924,044.46 | 2,459,945,916.55 | 99.99% | 179,863.48 | 0.01%   |
| 圆信永丰兴融 C | 109      | 1,715.63      | -                | -      | 187,003.61 | 100.00% |
| 合计       | 239      | 10,294,195.75 | 2,459,945,916.55 | 99.99% | 366,867.09 | 0.01%   |

### 9.2 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 | 圆信永丰兴融 A | 26,934.92 | 0.0011%  |
|                  | 圆信永丰兴融 C | 4,387.93  | 2.3464%  |
|                  | 合计       | 31,322.85 | 0.0013%  |

### 9.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 圆信永丰兴融 A | 0~10              |
|                                | 圆信永丰兴融 C | 0                 |
|                                | 合计       | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开                    | 圆信永丰兴融 A | 0                 |

|       |          |   |
|-------|----------|---|
| 开放式基金 | 圆信永丰兴融 C | 0 |
|       | 合计       | 0 |

注：报告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为 0-10 万份（含）。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 圆信永丰兴融 A         | 圆信永丰兴融 C     |
|---------------------------------|------------------|--------------|
| 基金合同生效日（2015 年 12 月 21 日）基金份额总额 | 200,403,493.19   | 519,611.71   |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 200,403,493.19   | 519,611.71   |
| 本报告期基金总申购份额                     | 2,260,525,285.70 | 2,063,207.34 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                   | 802,998.86       | 2,395,815.44 |
| 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                     | 2,460,125,780.03 | 187,003.61   |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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，基金管理人新聘任江涛先生为副总经理。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

随着债券市场的调整以及政策的一些变化，本基金采取了部分防守措施，包括降低杠杆比例，改善组合风险收益比并提升流动性。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。本年度支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 9.9 万元。该审计机构已提供审计服务的持续年限为 1

年。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华福证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

### 11.7.2 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 | 10,030,493.15 | 100.00%      | 1,693,300,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 华福证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |

注：1. 本报告期内基金新增 6 个证券公司交易单元，分别为兴业证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，国信证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，华福证券有限责任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。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

|   |
|---|
| - |
|---|

圆信永丰基金管理有限公司  
2017 年 3 月 31 日