

圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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。

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	1,328,399,051.74 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	1,254,924,259.70 份	73,474,792.04 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	郭明
	联系电话	021-60366000	010-66105799
	电子邮箱	service@gtsfund.com.cn	custody@icbc.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 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		2014 年 11 月 19 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日	
	圆信永丰双利 A	圆信永丰双利 C	圆信永丰双利 A	圆信永丰双利 C	圆信永丰双利 A	圆信永丰双利 C
本期已实现收益	83,463,123.11	4,164,242.60	327,729,630.16	87,082,476.53	40,327,937.12	6,518,689.21
本期利润	75,489,475.73	4,285,016.63	303,688,497.16	86,366,241.96	87,841,557.44	12,394,438.40
加权平均基金份额本期利润	0.0817	0.0665	0.7484	0.5613	0.1007	0.0865
本期基金份额净值增长率	3.96%	2.80%	77.16%	73.83%	10.40%	10.30%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0586	0.0444	0.0946	0.0835	0.0469	0.0457
期末基金资产净值	1,405,403,011.02	81,338,637.03	496,236,480.45	45,474,606.55	893,536,302.75	101,557,844.06
期末基金份额净值	1.120	1.107	1.167	1.156	1.104	1.103

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

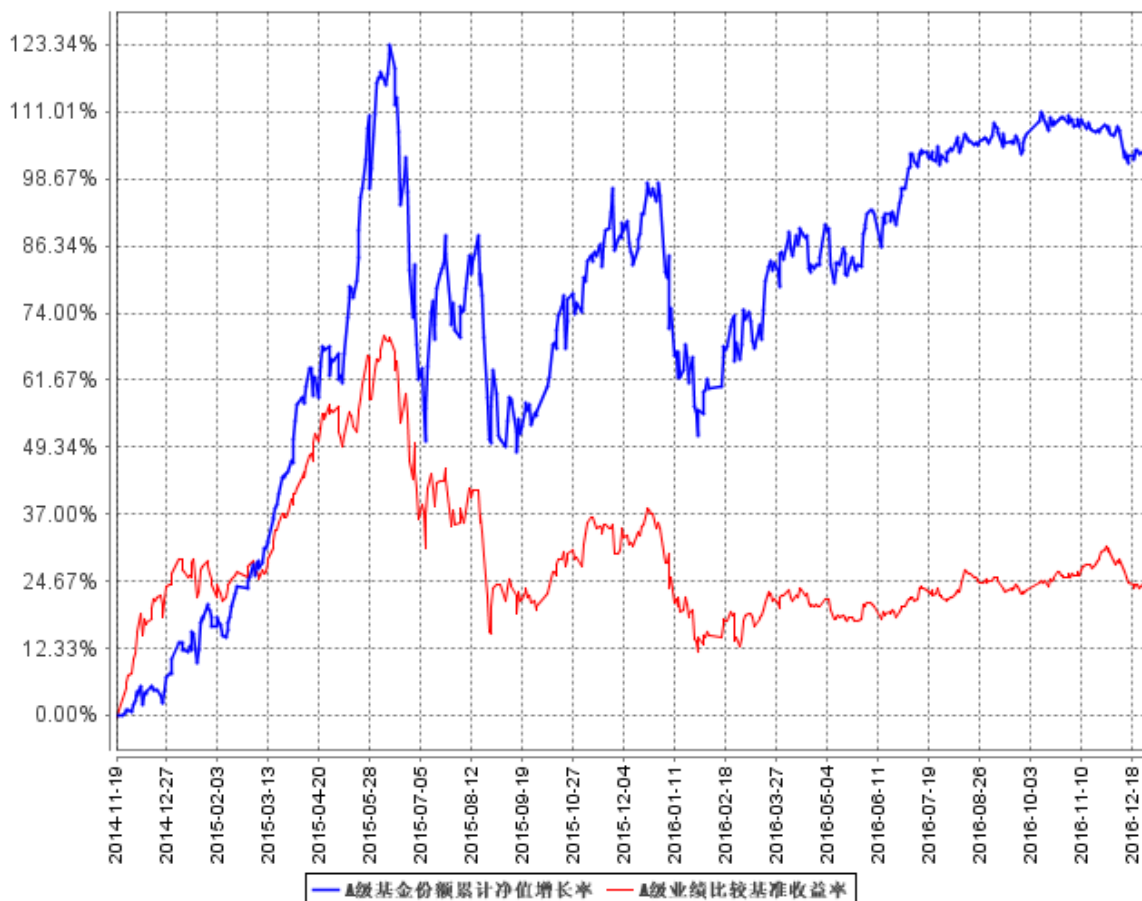
	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	-1.75%	0.53%	0.54%	0.51%	-2.29%	0.02%
过去六个月	3.32%	0.59%	3.07%	0.54%	0.25%	0.05%
过去一年	3.96%	1.45%	-8.02%	0.98%	11.98%	0.47%
自基金合同生效起至今	103.34%	1.88%	23.81%	1.42%	79.53%	0.46%

圆信永丰双利 C

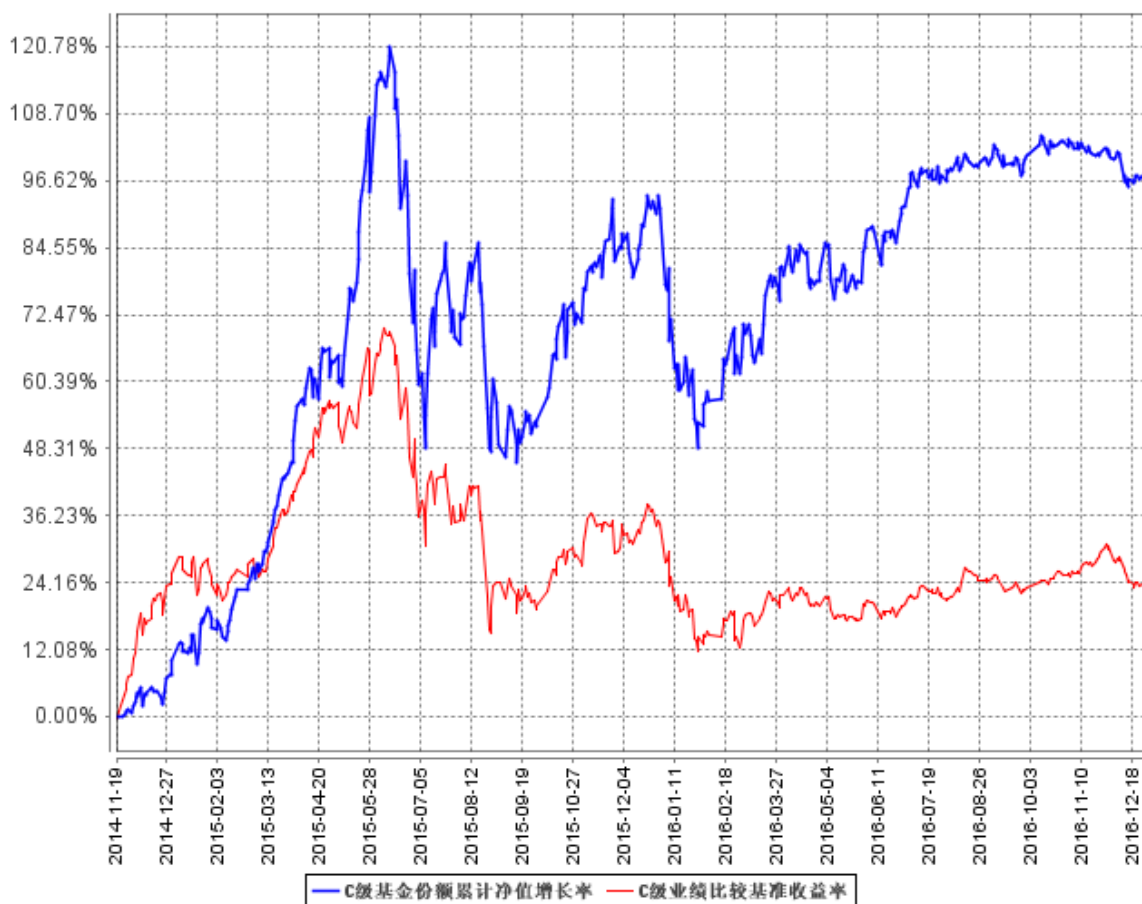
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.03%	0.53%	0.54%	0.51%	-2.57%	0.02%
过去六个月	2.69%	0.59%	3.07%	0.54%	-0.38%	0.05%
过去一年	2.80%	1.45%	-8.02%	0.98%	10.82%	0.47%
自基金合同生效起至今	97.10%	1.88%	23.81%	1.42%	73.29%	0.46%

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

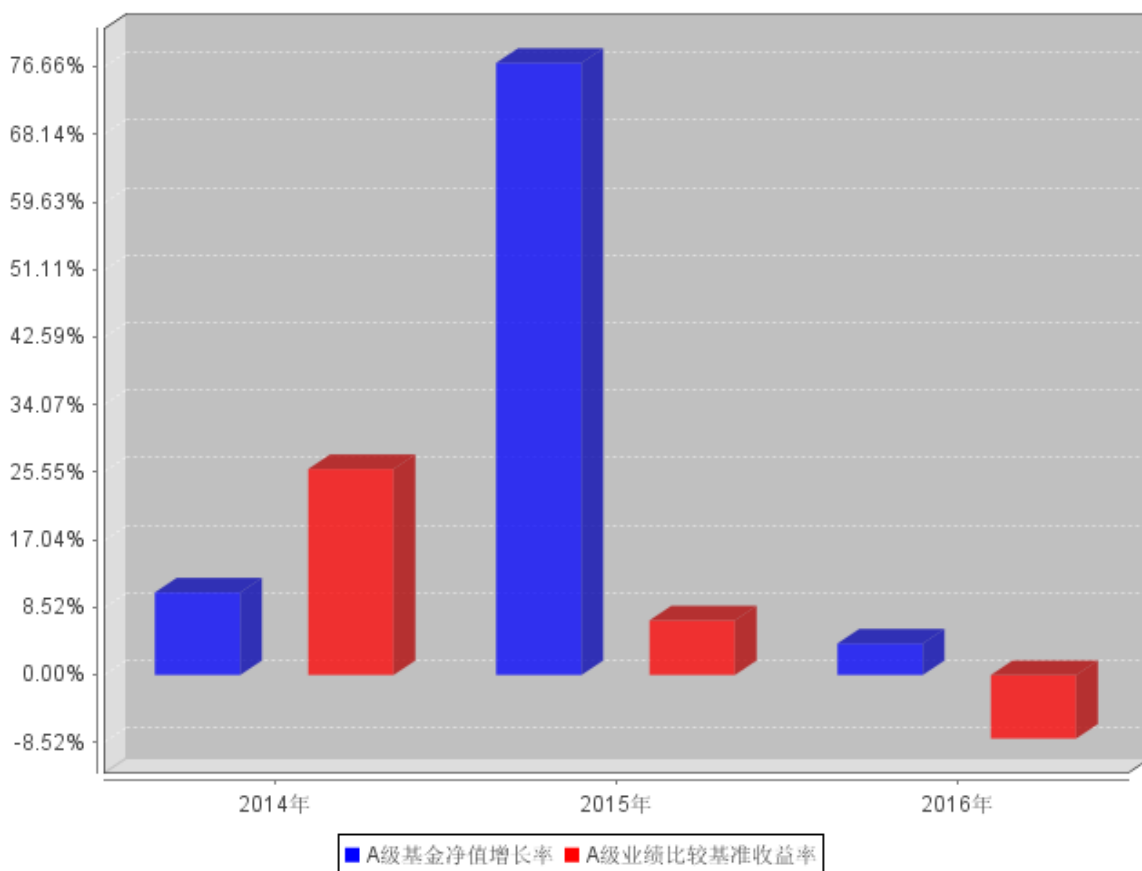


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

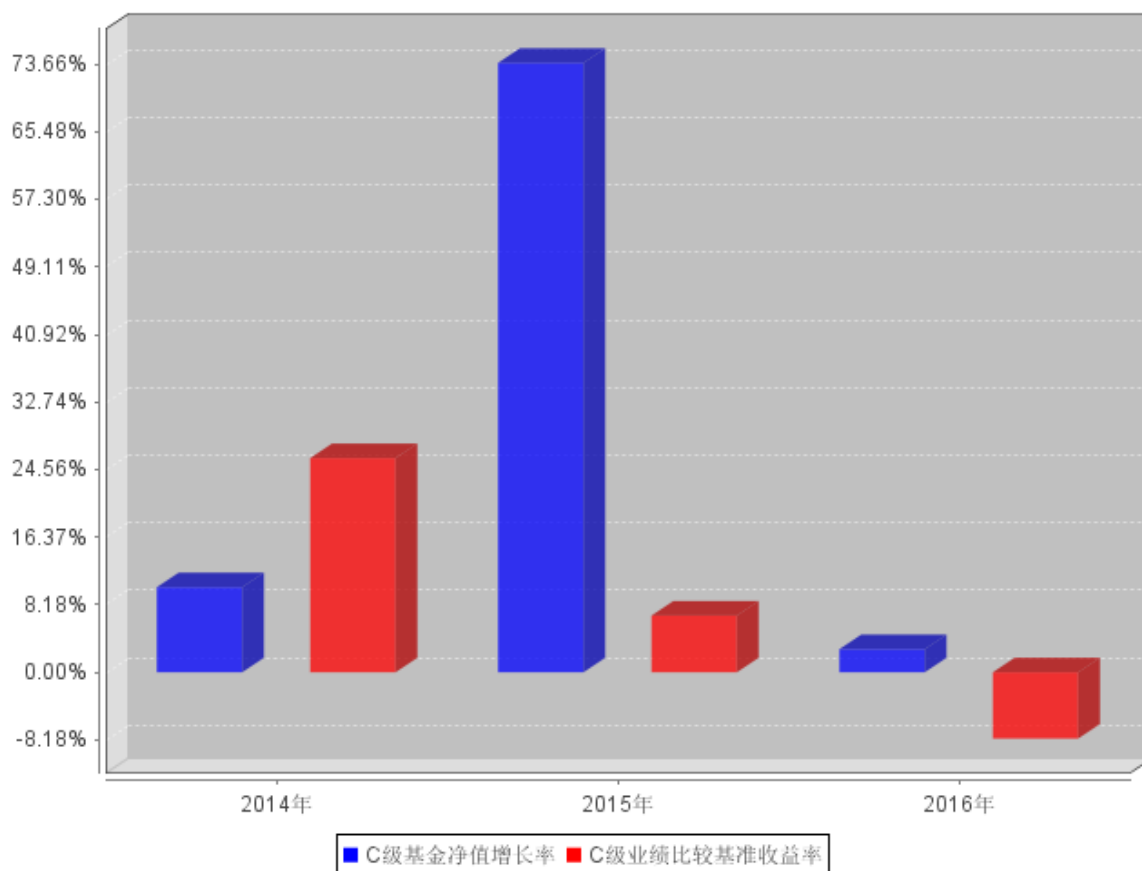


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

圆信永丰双利 A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	0.7600	14,483,459.10	20,331,984.29	34,815,443.39	
2015	6.8300	114,268,697.37	129,542,144.91	243,810,842.28	
2014	-	-	-	-	
合计	7.5900	128,752,156.47	149,874,129.20	278,626,285.67	

圆信永丰双利 C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	0.6700	443,750.71	2,398,754.94	2,842,505.65	
2015	6.6500	117,490,658.71	29,580,962.98	147,071,621.69	
2014	-	-	-	-	
合计	7.3200	117,934,409.42	31,979,717.92	149,914,127.34	

§ 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		
洪流	本基金基金经理	2014 年 11 月 19 日	-	18 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。
李家亮	本基金基金经理	2016 年 5 月 25 日	-	6 年	上海交通大学工商管理硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设权益投资部基金经理。历任上海杰运投资管理有限公司研究部研究员，邻智科技网络有限公司研究部研究员，圆信永丰基金管理有限公司研究部研究员。
范妍	本基金基金经理	2016 年 12 月 6 日	-	9 年	复旦大学管理学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设权益投资部总监。历任兴业证券研究中心助理策略分析师、安信证券研究中心高级策略分析师、工银瑞信基金策略研

					究员、圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设权益投资部副总监。
--	--	--	--	--	---------------------------------

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、《圆信永丰双红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 年全年的操作思路主要围绕寻找确定性增长和景气出现拐点的行业展开，把握了定制家居、养殖、MDI、造纸、白酒、电子元器件等领域的投资机会。四季度金融市场波动较大，全球债券收益率上行，市场的关注点转向财政政策而非货币政策。大宗商品、债券、股票市场出现了鲜明的配置切换。顺应这一趋势，我们在业绩期内增加了大金融、军工、PPP 等行业的配置。

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 1.120 元（累计净值 1.879 元）。报告期内本基金 A 类净值增长率为 3.96%，高于业绩比较基准 11.98 个百分点。截止 2016 年 12 月 31 日，本

基金 C 类份额净值 1.107 元（累计净值 1.839 元）。报告期内本基金 C 类净值增长率为 2.80%，高于业绩比较基准 10.82 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

2017 年的投资策略是价值股打底仓，成长股赚取超额收益。以上证 50 为代表的低估值股票，TTM 估值在 10 倍附近，部分股票的分红率超过 3%甚至 5%，为投资者提供了稳定的安全垫。这样的估值水平在全球范围内来看，也是偏低的。超额收益则来自优秀的成长股以及一些被错杀的行业，但需要仔细甄别。相对于当前的利率水平和潜在的资产配置压力，我们认为大类资产配置中，股票类资产优于大宗商品、房地产和债券。

行业配置上，看好大金融，消费升级受益的白酒、定制家具行业，军工，油气产业链等。高端白酒、乳制品等细分行业，竞争格局在优化，根据我们的微观调研，部分高端白酒目前处于经销商缺货的状态。另一方面，军工板块经历连续两年的调整后，估值逐渐回到合理区间，而且未来盈利的可测性也有所提高，加上混合所有制改革、股权激励、民参军等一系列利好因素的提振，预期 2017 年也将有所表现。大金融板块里，我们相对看好保险和银行，利率上行周期和企业盈利恢复有利于消除之前投资者对其业绩的担忧。主题投资上，我们关注国企改革的进展。

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、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配每年至多分配 12 次，每类基金份额的每份基金份额每次分配比例不低于收益分配基准日该类别每份基金份额可供分配利润的 80%；本基金报告期内实施利润分配 1 次，实际分配金额为 37,657,949.04 元。

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 37,657,949.04 元。

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 2016 年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 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 20210 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	圆信永丰双红利灵活配置混合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双红利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“圆信永丰双红利混合基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度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双红利混合基金的基金管理人

	圆信永丰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (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； (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。 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。 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，上述圆信永丰双红利混合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双红利混合基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度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：圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		45,381,858.47	34,666,600.52
结算备付金		22,025,523.69	3,774,578.49

存出保证金		494,217.44	905,617.46
交易性金融资产		1,331,640,869.03	500,869,327.12
其中：股票投资		1,119,713,347.33	464,154,250.92
基金投资		-	-
债券投资		211,927,521.70	36,715,076.20
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		50,000,000.00	-
应收证券清算款		40,029,677.79	3,231,592.98
应收利息		2,910,322.30	867,276.60
应收股利		-	-
应收申购款		3,639,710.56	14,328,231.41
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,496,122,179.28	558,643,224.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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		-	-
应付证券清算款		2,610,728.68	10,902,199.78
应付赎回款		3,019,716.77	3,250,256.50
应付管理人报酬		1,899,395.75	627,506.80
应付托管费		316,565.96	104,584.46
应付销售服务费		56,545.06	38,830.59
应付交易费用		1,313,207.77	1,895,750.41
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		164,371.24	113,009.04
负债合计		9,380,531.23	16,932,137.58
所有者权益：			
实收基金		1,328,399,051.74	464,448,449.97
未分配利润		158,342,596.31	77,262,637.03
所有者权益合计		1,486,741,648.05	541,711,087.00
负债和所有者权益总计		1,496,122,179.28	558,643,224.58

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，圆信永丰双红利混合基金 A 类份额净值 1.120 元，圆信永丰双红利混合基金 C 类份额净值 1.107 元，圆信永丰双红利混合基金基金份额总额

1,328,399,051.74 份，其中圆信永丰双红利混合基金 A 类份额 1,254,924,259.70 份，圆信永丰双红利混合基金 C 类份额 73,474,792.04 份。

7.2 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：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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		108,947,279.19	422,362,126.81
1.利息收入		5,157,328.58	2,252,271.55
其中：存款利息收入		934,791.62	572,403.83
债券利息收入		1,912,840.43	1,517,730.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,309,696.53	162,137.68
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		108,645,144.15	437,242,328.56
其中：股票投资收益		101,643,306.33	413,893,304.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益		445,286.69	19,209,043.06
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		6,556,551.13	4,139,981.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-7,852,873.35	-24,757,367.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		2,997,679.81	7,624,894.27
减：二、费用		29,172,786.83	32,307,387.69
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	16,019,318.36	10,388,351.98
2. 托管费	7.4.8.2.2	2,669,886.55	1,731,391.94
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	546,417.14	1,516,282.08
4. 交易费用		9,722,781.67	18,446,795.77
5. 利息支出		908.27	33,611.77
其中：卖出回购金融资产支出		908.27	33,611.77
6. 其他费用		213,474.84	190,954.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		79,774,492.36	390,054,739.12

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		79,774,492.36	390,054,739.12

7.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	464,448,449.97	77,262,637.03	541,711,087.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	79,774,492.36	79,774,492.36
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）	863,950,601.77	38,963,415.96	902,914,017.73
其中：1. 基金申购款	1,664,239,885.00	114,460,750.67	1,778,700,635.67
2. 基金赎回款	-800,289,283.23	-75,497,334.71	-875,786,617.94
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）	-	-37,657,949.04	-37,657,949.04
五、期末所有者权益（基金净值）	1,328,399,051.74	158,342,596.31	1,486,741,648.05
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 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）	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）	-	390,054,739.12	390,054,739.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-437,255,488.60	-15,299,846.36	-452,555,334.96

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、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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)占基金资产的 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，保持现金或到期日在一年以内的政府债券的比例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。本基金的业绩比较基准为：70%×沪深 300 指数收益率+30%×中债综合指数收益率。

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 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 日的财务状况以及 2016 年度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股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。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，暂免征收个人所得税。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。

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(“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(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
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1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,019,318.36	10,388,351.98
其中：支付销售机构的客户维护费	7,128,717.17	3,556,450.38

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 1.50% 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 × 1.50% / 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1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,669,886.55	1,731,391.94

注：支付基金托管人中国工商银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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		
	圆信永丰双利 A	圆信永丰双利 C	合计

圆信永丰基金公司	-	307,160.62	307,160.62
中国工商银行	-	145,623.63	145,623.63
合计	-	452,784.25	452,784.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	圆信永丰双利 A	圆信永丰双利 C	合计
圆信永丰基金公司	-	1,195,048.23	1,195,048.23
中国工商银行	-	210,005.15	210,005.15
合计	-	1,405,053.38	1,405,053.38

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0.80%。其计算公式为：

C类基金份额日销售服务费 = 前一日C类基金资产净值 × 0.80% / 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固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间内均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

注：本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至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
中国工商银行	45,381,858.47	788,320.02	34,666,600.52	449,210.16

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。

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

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 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
601801	皖新传媒	2016 年 9 月 6 日	2017 年 9 月 6 日	非公开发行	11.82	13.66	1,184,433	13,999,998.06	16,179,354.78	
002821	凯莱英	2016 年 11 月 11 日	2017 年 11 月 13 日	老股配售	30.53	143.49	21,409	653,616.77	3,071,977.41	
603823	百合花	2016 年 12 月 9 日	2017 年 12 月 11 日	老股配售	10.60	32.74	36,764	389,698.40	1,203,653.36	
603660	苏州科达	2016 年 11 月 21 日	2017 年 11 月 21 日	老股配售	8.03	32.22	26,007	208,836.21	837,945.54	
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股未上市	23.16	23.16	5,400	125,064.00	125,064.00	
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	
300587	天铁股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 5 日	新股未上市	14.11	14.11	3,451	48,693.61	48,693.61	
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股未上市	7.87	7.87	4,819	37,925.53	37,925.53	
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股未上市	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	
603186	华正新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 3 日	新股未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	
603032	德新交运	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股未上市	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股未上市	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	
300588	熙菱信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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一层次的余额为 1,097,858,095.78 元，属于第二层次的余额为 233,782,773.25，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 444,522,198.92 元，属于第二层次的余额为 56,347,128.20 元，无属于第三层次的余额)。

(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	1,119,713,347.33	74.84
	其中：股票	1,119,713,347.33	74.84
2	固定收益投资	211,927,521.70	14.17
	其中：债券	211,927,521.70	14.17
	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	50,000,000.00	3.34
	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	67,407,382.16	4.51
7	其他各项资产	47,073,928.09	3.15
8	合计	1,496,122,179.28	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

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	27,361,513.62	1.84
B	采矿业	47,012,775.57	3.16
C	制造业	835,232,379.49	56.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	45,126,126.79	3.04
F	批发和零售业	26,488,000.00	1.78
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.02

J	金融业	101,895,870.20	6.85
K	房地产业	-	-
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	20,166,176.00	1.36
R	文化、体育和娱乐业	16,179,354.78	1.09
S	综合	-	-
	合计	1,119,713,347.33	75.31

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

8.3 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	600519	贵州茅台	223,300	74,615,695.00	5.02
2	002572	索菲亚	1,366,303	73,998,970.48	4.98
3	600535	天士力	1,280,861	53,142,922.89	3.57
4	600584	长电科技	2,680,000	47,302,000.00	3.18
5	600028	中国石化	8,689,977	47,012,775.57	3.16
6	000498	山东路桥	5,688,592	45,110,534.56	3.03
7	601318	中国平安	1,180,000	41,807,400.00	2.81
8	002078	太阳纸业	6,180,998	41,289,066.64	2.78
9	600309	万华化学	1,780,000	38,323,400.00	2.58
10	600987	航民股份	3,000,828	37,030,217.52	2.49

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600519	贵州茅台	94,739,986.93	17.49
2	300059	东方财富	94,123,695.85	17.38
3	002456	欧菲光	91,696,929.48	16.93
4	300207	欣旺达	90,217,246.60	16.65
5	002117	东港股份	86,624,834.50	15.99
6	600584	长电科技	81,494,938.17	15.04
7	002078	太阳纸业	69,609,028.06	12.85
8	600885	宏发股份	68,714,523.68	12.68
9	002001	新 和 成	67,049,065.94	12.38
10	002690	美亚光电	66,247,686.45	12.23
11	600398	海澜之家	65,149,337.36	12.03
12	600309	万华化学	63,720,076.78	11.76
13	002299	圣农发展	63,004,192.34	11.63
14	600195	中牧股份	62,468,362.08	11.53
15	601801	皖新传媒	62,061,001.92	11.46
16	000333	美的集团	61,689,343.52	11.39
17	002234	民和股份	60,779,271.73	11.22
18	601318	中国平安	58,270,809.03	10.76
19	600978	宜华生活	57,302,172.51	10.58
20	000915	山大华特	56,905,734.82	10.50
21	002572	索菲亚	54,789,024.37	10.11
22	000581	威孚高科	52,347,102.95	9.66
23	600535	天士力	51,016,897.71	9.42
24	600036	招商银行	49,911,345.23	9.21
25	300054	鼎龙股份	48,761,084.96	9.00
26	600987	航民股份	47,208,920.94	8.71
27	600436	片仔癀	46,758,395.50	8.63
28	000498	山东路桥	45,506,219.34	8.40
29	600028	中国石化	44,959,303.35	8.30
30	600511	国药股份	44,115,344.29	8.14
31	603609	禾丰牧业	42,974,455.54	7.93
32	002179	中航光电	42,598,441.70	7.86
33	300033	同花顺	40,192,211.00	7.42
34	300232	洲明科技	39,972,695.88	7.38
35	002714	牧原股份	39,343,640.80	7.26

36	600079	人福医药	38,823,897.48	7.17
37	000858	五粮液	37,420,664.93	6.91
38	600694	大商股份	35,397,345.13	6.53
39	002519	银河电子	34,935,720.93	6.45
40	002475	立讯精密	34,717,594.23	6.41
41	603899	晨光文具	33,743,027.65	6.23
42	002241	歌尔股份	33,092,603.33	6.11
43	600266	北京城建	32,791,783.56	6.05
44	600702	沱牌舍得	31,487,333.24	5.81
45	002007	华兰生物	29,933,589.58	5.53
46	300115	长盈精密	29,789,611.22	5.50
47	600240	华业资本	29,741,956.00	5.49
48	600557	康缘药业	29,380,153.21	5.42
49	600887	伊利股份	29,343,734.81	5.42
50	002152	广电运通	28,792,698.56	5.32
51	001979	招商蛇口	28,029,975.53	5.17
52	002250	联化科技	27,645,741.06	5.10
53	002311	海大集团	26,545,086.77	4.90
54	000895	双汇发展	26,417,577.44	4.88
55	002191	劲嘉股份	24,438,891.07	4.51
56	600517	置信电气	23,363,037.30	4.31
57	300244	迪安诊断	23,175,605.25	4.28
58	600009	上海机场	22,712,908.20	4.19
59	002081	金螳螂	22,597,868.10	4.17
60	002563	森马服饰	21,669,557.19	4.00
61	300070	碧水源	20,782,823.11	3.84
62	000402	金融街	20,685,672.00	3.82
63	600038	中直股份	20,538,705.10	3.79
64	002508	老板电器	20,521,157.66	3.79
65	002366	台海核电	19,591,882.40	3.62
66	600048	保利地产	19,063,021.39	3.52
67	000603	盛达矿业	18,924,977.46	3.49
68	300017	网宿科技	18,758,795.11	3.46
69	600158	中体产业	18,432,910.50	3.40
70	601939	建设银行	18,366,913.73	3.39
71	600500	中化国际	18,069,517.58	3.34

72	600325	华发股份	17,146,082.99	3.17
73	600794	保税科技	17,133,356.30	3.16
74	300119	瑞普生物	16,919,006.76	3.12
75	002026	山东威达	16,812,650.96	3.10
76	002701	奥瑞金	16,669,501.14	3.08
77	002157	正邦科技	15,085,680.85	2.78
78	002008	大族激光	14,689,507.82	2.71
79	600803	新奥股份	14,272,625.54	2.63
80	600563	法拉电子	13,390,767.32	2.47
81	601336	新华保险	13,332,142.05	2.46
82	000758	中色股份	13,089,701.98	2.42
83	300287	飞利信	13,016,557.83	2.40
84	000709	河钢股份	12,607,855.00	2.33
85	002624	完美世界	12,529,342.54	2.31
86	002254	泰和新材	12,439,922.11	2.30
87	002271	东方雨虹	12,191,619.82	2.25
88	601377	兴业证券	11,528,406.79	2.13
89	600271	航天信息	11,509,645.83	2.12
90	600718	东软集团	11,315,650.00	2.09
91	002462	嘉事堂	11,025,352.94	2.04
92	000728	国元证券	11,024,711.52	2.04
93	600879	航天电子	10,940,690.23	2.02

8.4.2 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	300059	东方财富	92,107,353.70	17.00
2	300207	欣旺达	91,637,790.54	16.92
3	600885	宏发股份	83,828,412.05	15.47
4	002234	民和股份	77,340,809.66	14.28
5	000333	美的集团	68,568,726.30	12.66
6	002456	欧菲光	65,955,353.92	12.18
7	601801	皖新传媒	62,081,415.24	11.46
8	002117	东港股份	60,907,405.22	11.24
9	000915	山大华特	60,734,853.83	11.21

10	002714	牧原股份	58,821,275.72	10.86
11	600978	宜华生活	56,825,659.24	10.49
12	002001	新和成	55,420,762.68	10.23
13	600584	长电科技	49,346,451.66	9.11
14	000858	五粮液	49,098,890.91	9.06
15	603609	禾丰牧业	44,133,145.09	8.15
16	002250	联化科技	43,497,322.47	8.03
17	600195	中牧股份	43,379,215.27	8.01
18	002078	太阳纸业	41,959,444.28	7.75
19	002554	惠博普	40,717,005.04	7.52
20	002299	圣农发展	40,595,913.50	7.49
21	300033	同花顺	39,176,408.04	7.23
22	600887	伊利股份	39,174,757.31	7.23
23	600309	万华化学	39,106,276.05	7.22
24	600325	华发股份	38,832,282.46	7.17
25	002475	立讯精密	38,550,351.80	7.12
26	600694	大商股份	35,704,782.45	6.59
27	002007	华兰生物	35,494,303.66	6.55
28	600702	沱牌舍得	35,040,506.69	6.47
29	300054	鼎龙股份	34,743,216.16	6.41
30	600519	贵州茅台	34,456,827.85	6.36
31	002241	歌尔股份	34,321,149.54	6.34
32	603899	晨光文具	34,159,382.40	6.31
33	600266	北京城建	33,529,555.36	6.19
34	002690	美亚光电	33,402,278.52	6.17
35	002563	森马服饰	31,134,112.83	5.75
36	001979	招商蛇口	30,159,548.39	5.57
37	002152	广电运通	29,891,289.04	5.52
38	002572	索菲亚	28,649,027.15	5.29
39	600398	海澜之家	28,524,239.11	5.27
40	600038	中直股份	28,348,147.93	5.23
41	002311	海大集团	27,398,189.67	5.06
42	600240	华业资本	27,348,098.51	5.05
43	000895	双汇发展	27,259,319.81	5.03
44	002454	松芝股份	26,319,376.60	4.86
45	600517	置信电气	25,514,229.50	4.71
46	002191	劲嘉股份	23,979,705.99	4.43
47	600009	上海机场	23,216,701.94	4.29

48	002366	台海核电	21,383,902.50	3.95
49	002081	金螳螂	21,253,210.66	3.92
50	600036	招商银行	20,854,619.10	3.85
51	300070	碧水源	20,398,237.08	3.77
52	300017	网宿科技	20,241,183.50	3.74
53	002508	老板电器	20,010,378.38	3.69
54	600048	保利地产	19,513,361.56	3.60
55	601628	中国人寿	19,499,480.66	3.60
56	000402	金融街	19,289,055.64	3.56
57	000603	盛达矿业	19,081,175.24	3.52
58	600158	中体产业	19,016,482.47	3.51
59	000513	丽珠集团	18,779,557.16	3.47
60	002124	天邦股份	18,638,644.45	3.44
61	600794	保税科技	18,521,960.92	3.42
62	300284	苏交科	16,969,453.86	3.13
63	300232	洲明科技	16,767,196.00	3.10
64	601318	中国平安	16,516,116.63	3.05
65	600436	片仔癀	16,512,986.98	3.05
66	300119	瑞普生物	16,417,505.07	3.03
67	002701	奥瑞金	16,081,712.06	2.97
68	000581	威孚高科	15,720,875.08	2.90
69	600079	人福医药	15,574,853.68	2.88
70	600511	国药股份	15,316,602.10	2.83
71	600803	新奥股份	14,900,714.75	2.75
72	000060	中金岭南	14,680,597.56	2.71
73	002008	大族激光	14,339,140.82	2.65
74	300287	飞利信	13,971,432.87	2.58
75	002157	正邦科技	13,882,046.00	2.56
76	600563	法拉电子	12,876,412.20	2.38
77	002271	东方雨虹	12,865,750.61	2.38
78	002179	中航光电	12,301,827.96	2.27
79	300271	华宇软件	12,232,858.50	2.26
80	600382	广东明珠	11,938,790.29	2.20
81	002658	雪迪龙	11,871,507.57	2.19
82	000758	中色股份	11,744,897.70	2.17
83	601688	华泰证券	11,513,959.20	2.13
84	000709	河钢股份	11,503,169.01	2.12
85	002624	完美世界	11,459,816.25	2.12

86	600064	南京高科	11,261,388.45	2.08
87	002462	嘉事堂	10,958,652.43	2.02
88	601377	兴业证券	10,927,665.01	2.02

8.4.3 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	3,697,690,152.04
卖出股票收入（成交）总额	3,136,092,056.00

8.5 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	82,378,521.70	5.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	79,709,000.00	5.36
	其中：政策性金融债	79,709,000.00	5.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	49,840,000.00	3.35
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	211,927,521.70	14.25

8.6 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	019539	16 国债 11	500,000	49,935,000.00	3.36
2	011698303	16 华电 SCP013	500,000	49,840,000.00	3.35
3	070209	07 国开 09	500,000	49,745,000.00	3.35
4	019533	16 国债 05	320,000	32,000,000.00	2.15
5	120210	12 国开 10	300,000	29,964,000.00	2.02

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 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合约。

8.10.2 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合约。

8.11 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交易。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

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。

8.12.2

本基金投资前十名股票中，不存在投资于超过基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 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	494,217.44
2	应收证券清算款	40,029,677.79
3	应收股利	-
4	应收利息	2,910,322.30
5	应收申购款	3,639,710.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	47,073,928.09
---	----	---------------

8.12.4 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。

8.12.5 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未存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§ 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
圆信永丰双利 A	28,564	43,933.77	304,966,298.92	24.30%	949,957,960.78	75.70%
圆信永丰双利 C	28	2,624,099.72	29,666,842.01	40.38%	43,807,950.03	59.62%
合计	28,592	46,460.52	334,633,140.93	25.19%	993,765,910.81	74.81%

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	圆信永丰双利 A	674,169.15	0.0537%
	圆信永丰双利 C	3,840,058.42	5.2264%
	合计	4,514,227.57	0.3398%

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	圆信永丰双利 A	50~100
	圆信永丰双利 C	>100

有本开放式基金	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	50~100
	圆信永丰双利 C	>100
	合计	>100

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 100 万份以上。

§ 10 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	425,110,482.21	39,337,967.76
本报告期基金总申购份额	1,605,758,196.74	58,481,688.26
减：本报告期基金总赎回份额	775,944,419.25	24,344,863.98
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,254,924,259.70	73,474,792.04

§ 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。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。

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

本报告期内，本基金投资策略未改变。

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 8.19 万元。该审计机构已提供审计服务的持续年限为 2 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	1,804,377,251.66	26.50%	1,680,418.54	28.09%	-
招商证券	2	791,408,937.81	11.62%	737,038.32	12.32%	-
东方证券	2	791,313,441.35	11.62%	578,687.07	9.67%	-
海通证券	2	667,987,374.69	9.81%	622,095.72	10.40%	-
华泰证券	1	494,719,329.04	7.26%	361,788.80	6.05%	-
中信证券	2	438,701,371.45	6.44%	408,562.79	6.83%	-
国泰君安	2	392,224,605.00	5.76%	365,278.96	6.11%	-
中金公司	2	375,208,930.34	5.51%	349,432.64	5.84%	-
东吴证券	2	278,181,131.20	4.08%	203,433.76	3.40%	-
平安证券	2	239,010,184.42	3.51%	174,789.29	2.92%	-
申万宏源证券	2	237,378,028.50	3.49%	221,070.24	3.70%	-
安信证券	2	187,198,585.51	2.75%	174,337.22	2.91%	-
中信建投	2	112,455,389.41	1.65%	104,729.80	1.75%	-

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	4,614,967.06	4.25%	4,410,000,000.00	32.43%	-	-

招商证券	40,449,219.00	37.21%	300,000,000.00	2.21%	-	-
东方证券	12,299,059.20	11.31%	2,328,000,000.00	17.12%	-	-
海通证券	20,016,400.20	18.41%	1,055,000,000.00	7.76%	-	-
华泰证券	139,754.75	0.13%	-	-	-	-
中信证券	-	-	1,100,000,000.00	8.09%	-	-
国泰君安	955,066.11	0.88%	630,000,000.00	4.63%	-	-
中金公司	20,316,434.40	18.69%	797,000,000.00	5.86%	-	-
东吴证券	1,903,035.30	1.75%	1,610,000,000.00	11.84%	-	-
平安证券	-	-	1,367,800,000.00	10.06%	-	-
申万宏源证券	8,006,400.00	7.37%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

注：1. 本报告期内基金新增 7 个证券公司交易单元，分别为华泰证券股份有限公司深交所交易单元，平安证券有限责任公司上交所及深交所交易单元，东吴证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，天风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