

圆信永丰纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2016 年第 2 号)

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

时间：二〇一七年一月

【重要提示】

本基金的募集申请经中国证监会 2014 年 4 月 15 日证监许可〔2014〕415 号文准予募集注册，基金合同已于 2014 年 5 月 30 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资者在投资本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金的投资范围中包括中小企业私募债券，该券种具有较高的流动性风险和信用风险，可能增加本基金总体风险水平。中小企业私募债券是指中小微型企业在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券，其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。因此，中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益品种，其预期风险及预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价

格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2016年11月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日（未经审计）。

一、基金管理人

一、概况

名称：圆信永丰基金管理有限公司

住所：中国（福建）自由贸易试验区厦门片区（保税港区）海景南二路45号4楼02单元之175

办公地址：中国上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦19楼

成立时间：2014年1月2日

法定代表人：洪文瑾

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可（2013）1514号

注册资本：20,000万元人民币

股权结构：厦门国际信托有限公司（以下简称“厦门国际信托”）持有51%的股权；永丰证券投资信托股份有限公司（以下简称“永丰投信”）持有49%的股权。

电话：（021）60366000 传真：（021）60366001

客服电话：400-607-0088

网址：www.gtsfund.com.cn

联系人：严晓波

二、主要人员情况

（一）董事会成员

董事长：

洪文瑾女士，公司董事长，厦门大学工商管理硕士。历任厦门建发集团财务部副经理，厦门建发信托投资公司副总经理、总经理，厦门国际信托有限公司总经理、董事长，2012年11月起兼任厦门金圆投资集团有限公司副总经理。

独立董事：

戴亦一先生，公司独立董事，厦门大学研究生学历，经济学博士学位。历任

厦门大学经济学院计统系讲师、副教授；厦门大学管理学院副教授/EMBA 中心副主任、教授/EMBA 中心主任、教授/博导/副院长、教授/博导；福建新华都购物广场股份有限公司独立董事、厦门兴业能源控股股份有限公司独立董事。

朱孟楠先生，公司独立董事，厦门大学金融学博士。历任厦门大学经济学院财金系助教、讲师、副教授、教授、博士生导师，厦门大学经济学院金融系教授、博士生导师、系主任，厦门大学经济学院副院长。

股东董事：

郑木清先生，公司董事，复旦大学国际金融学博士、中国社会科学院法学博士后、中共中央党校哲学博士后。历任中国建设银行总行利率处负责人，海通证券股份有限公司高级证券分析师、投资经理、中外合资海富通基金管理公司筹备组成员，海富通基金管理公司总裁特别助理，甘肃省人民政府办公厅主任助理、厅领导成员，东吴基金管理公司总裁助理、量化投资总监兼量化投资部总经理；现任厦门金圆投资集团有限公司总经理助理，兼任金圆资本管理（厦门）有限公司董事长、总经理。

董晓亮先生，公司董事，厦门大学经济学博士。历任国贸期货上海代表处出市代表负责人、研发部研究员，兴业证券厦门投资银行总部业务经理，国贸期货总经理助理、副总经理、常务副总经理、总经理，海通期货副总经理，金圆集团投资部副总经理；现任圆信永丰基金管理有限公司总经理。

许如玫女士，公司董事，美国德州州立大学企业管理硕士。历任建弘国际投资顾问研究员，建弘证券经理，建弘投信基金经理、营销企划部门主管，永丰金资产管理(亚洲)董事总经理，永丰证券投资信托股份有限公司总经理；现任永丰永丰金融控股股份有限公司投资长办公室主任。

吴嘉钦先生，公司董事，台湾科技大学硕士。历任宝来证券国际金融部副总经理、宝来投信综合通路处及投资产品中心副总经理、元大宝来投信通路事业部资深副总经理；现任永丰证券投资信托股份有限公司总经理。

蔡隆裕先生，公司董事，国立台湾大学电机所硕士。历任永丰金证券副总经理、永丰金资本(亚洲)有限公司董事，SPS Asset Management Ltd. 董事，永丰金亚洲有限公司董事；现任永丰金证券(亚洲)有限公司董事总经理。

（二）监事会成员

薛经武先生，公司监事长，荷兰伊拉斯莫斯大学鹿特丹管理学院研究所企业管理硕士。历任环球经济社研究员，台湾经济研究院专案特约研究员，欧洲品质管理基金会专案特约研究员，日商日兴证券台北分公司研究部主管，永丰金控总经理办公室副总经理，永丰金证券(亚洲)有限公司上海代表处代表。

胡荣炜先生，公司监事，厦门大学工商管理硕士。历任中国银行厦门市分行营业部职员、风险管理部职员、风险管理处业务审查科副科长、风险管理部尽职调查科科长，柯达（中国）股份有限公司亚太影像材料制造乐凯并购项目财务经理，柯达（厦门）数码影像有限公司财务经理，柯达中国区制造财务内控总监，厦门磐基大酒店有限公司集团副总经理，厦门金圆投资集团有限公司投资经理，厦门市创业投资有限公司总经理助理、副总经理；现任厦门国际信托有限公司副总经理。

吴焯女士，公司职工监事、综合管理部总监，华东师范大学本科学历。历任江苏联合信托投资有限公司人事行政主管、德邦证券有限责任公司人力资源部薪酬福利经理，湘财证券股份有限公司人力资源与发展总部人事经理。

高晶女士，公司职工监事、监察稽核部总监，上海交通大学金融英语及国际贸易双学士。历任普华永道中天会计师事务所审计鉴证部金融分部高级审计员，上投摩根基金管理有限公司监察稽核部资深内部审计经理。

（三）公司总经理及其他高级管理人员

董晓亮先生，公司总经理，简历见上。

吕富强先生，公司督察长，厦门大学法学博士。历任华东地质学院助教，厦门国际信托投资公司证券总部投资银行部业务主办，厦门国际信托投资公司信托部业务主办、市场开发部副经理、风险控制部经理，厦门国际信托合规管理部总经理、风险管理部总经理。

江涛先生，公司副总经理，安徽大学经济学硕士，历任交通银行安徽分行国际部副总经理、交通银行东京分行国际部总经理、交通银行安徽分行个金部总经理、融通基金北京分公司副总经理、融通基金上海分公司总经理。

（四）本基金基金经理

许燕女士，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基金经理。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。

林铮先生，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。

余文龙先生，上海财经大学金融数学与金融工程博士，现任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总监。2011-2014年任职上海申银万国证券研究所债券高级分析师，荣获过2011-2013年新财富固定收益最佳分析师团队第一名和第二名，2014-2016年5月任职于中信证券资产管理部资产管理业

务副总裁、年金保险组固定收益投资经理。

(五) 公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务

董晓亮先生，公司总经理；洪流先生，首席投资官；李明阳先生，研究部副总监；余文龙先生，固定收益投资部总监；王琳女士，交易部总监；范妍女士，权益投资部副总监。

(六) 上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

(一) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(二) 办理基金备案手续；

(三) 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

(四) 按照《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

(五) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(六) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(七) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

(八) 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(九) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(十) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(十一) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(十二) 有关法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

(一) 本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会有关规定的行为发生。

(二) 本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- 1、将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- 2、不公平地对待管理人管理的不同基金财产；
- 3、利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

- 4、向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- 5、侵占、挪用基金财产；
- 6、泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- 7、玩忽职守，不按照规定履行职责；
- 8、法律、行政法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

（三）本基金管理人承诺加强员工管理和培训，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- 1、越权或违规经营；
- 2、违反《基金合同》或《托管协议》；
- 3、故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- 4、在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- 5、拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- 6、玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- 7、违反现行有效的有关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- 8、除按基金管理人制度进行基金、特定多个客户资产管理计划运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- 9、协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- 10、违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- 11、贬损同行，以抬高自己；
- 12、以不正当手段谋求业务发展；
- 13、有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- 14、在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- 15、其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

（四）基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、违反规定向他人贷款或者提供担保；

- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资；
- 6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 7、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

（五）基金经理承诺

1、依照有关法律、法规和《基金合同》的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取不当利益；

3、不违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的内部控制制度

基金管理人的内部风险控制制度包括内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等。内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，对各项基本管理制度的总揽和指导。内部控制大纲明确了内部控制目标和原则、内部控制组织体系、内部控制制度体系、内部控制环境、内部控制措施等。基本管理制度包括风险控制制度、基金投资管理制度、基金绩效评估考核制度、集中交易制度、基金会计制度、信息披露制度、信息系统管理制度、员工保密制度、危机处理制度、监察稽核制度等。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、工作要求、业务流程等的具体说明。

根据基金管理业务的特点，公司设立顺序递进、权责统一、严密有效的四道内控防线：

公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统

一、严密有效的内控防线：

1、建立以各岗位目标责任制为基础的第一道内控防线。员工积极发挥主观能动性，在严于律己的前提下，相互监督制衡。各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授

权范围内承担责任。

2、建立相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道内控防线。公司在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部部门及岗位负有监督责任。

3、建立以公司督察长、监察稽核部门对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道防线。督察长、监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

4、建立以董事会下属风险管理委员会对公司经营管理和基

金运作中的合法合规性实行全面监督的第四道防线。风险管理委员会对公司经营和基金运作中的风险进行严格的合规检查和风险控制评估并审议公司风险管理工作报告。

二、基金托管人

一、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

二、主要人员情况

截至 2016 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 210 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体

系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 624 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 51 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

一、基金份额发售机构

（一）直销机构

1、圆信永丰基金管理有限公司直销中心

上海直销中心办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦
19 楼

电话：021-60366013

传真：021-60366001

厦门直销中心办公地址：厦门市思明区展鸿路 82 号金融中心大厦 21 楼
2102 室

电话：0592-3016513

传真：0592-3016501

网址：www.gtsfund.com.cn

2、电子直销

1) 名称：圆信永丰基金管理有限公司电子直销

交易网站：www.gtsfund.com.cn

客服电话：4006070088；021-60366818

2) 名称：圆信永丰基金管理有限公司电子直销系统之微信交易端口

圆信永丰基金微信公众号：[gtsfund4006070088](https://www.gtsfund.com.cn)

客服电话：4006070088；021-60366818

（二）其他销售机构

1、中国工商银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

联系人：赵会军

2、兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

住所：上海市民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20-22 楼

法定代表人：兰荣

客服电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

3、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室

住所：杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室

法定代表人：陈柏青

公司网址：www.fund123.cn

4、上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

5、中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

公司网址：www.csc108.com

客服电话：95587 4008-888-108

6、海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服电话：95553

公司网址：www.htsec.com

7、中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客服电话：4008-888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

8、中信建投期货有限公司

注册地址：渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B，名义层 11-A，8-B4，9-B、C

住所：渝中区中山三路 107 号皇冠大厦 11 楼

法定代表人：彭文德

客服电话：4008877780

公司网址：www.cfc108.com

9、厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

住所：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

法定代表人：林松

客服电话：0592-3122731

公司网址：www.xds.com

交易网址：www.dkhs.com.cn

10、上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 路 1033 室

住所：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

客服电话：400-067-6266

公司网址：www.leadfund.com.cn

11、上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公住址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

客服电话：4008219031

12、华福证券有限责任公司

办公地址：福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-10 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：4008896326

网址：<http://www.hfzq.com.cn/>

13、上海中正达广投资管理有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

客服电话：4006767523

网址：<http://www.zzwealth.cn>

14、浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

法定代表人：徐黎云

客服电话：4000680058

网址：www.jincheng-fund.com

15、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

电话：4008215399

公司网址：www.noah-fund.com

16、上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

联系人：王亚丹

客服电话：4008210203

17、上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：陆敏

客服电话：4007009665

公司网址：www.ehowbuy.com

18、恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

办公地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

客服电话：4001966188

公司网址：www.cnht.com.cn

19、申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

客服电话：4008000562

公司网址：www.swhysc.com

20、申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦
20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦
20 楼 2005 室

法定代表人：李季

联系人：黄莹

客服电话：4008000562

公司网址：www.hysec.com

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和《基金合同》
等的规定，调整销售机构或选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时履行信
息披露义务。

二、注册登记机构

圆信永丰基金管理有限公司（同上）

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

经办律师：安冬、孙睿

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：（021）23238888 传真：（021）23238800

联系人：陈邈迪

经办注册会计师：单峰、陈邈迪

四、基金概况

名称：圆信永丰纯债债券型证券投资基金

类型： 债券型证券投资基金。

五、基金的申购与赎回

一、申购费、赎回费

1、本基金的申购费率如下：

本基金 A 类基金份额的申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。



注：M 为申购金额，单位为人民币；A 类基金份额申购费用由投资人承担，不列入基金财产。

2、本基金的赎回费率如下：

A 类基金份额



C 类基金份额



注：N 为基金份额持有期限

3、本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。应当将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。赎回费中计入基金财产之余的费用用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间

间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

二、本基金申购份额的计算

本基金申购采用“金额申购”的方式。基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算公式为：

1、若投资者选择申购 A 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

(1) 申购费用适用比例费率时：

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额的基金份额净值

(2) 申购费用适用固定金额时：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额的基金份额净值

2、若投资人选择申购 C 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额的基金份额净值

三、本基金赎回金额的计算

本基金采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

1、若投资者赎回 A 类基金份额，则赎回金额的计算公式为：

赎回金额=赎回份额×T 日 A 类基金份额的基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

赎回金额=赎回金额-赎回费用

2、若投资者赎回 C 类基金份额，则赎回金额的计算公式为：

赎回金额 = 赎回份额 × T 日 C 类基金份额的基金份额净值

赎回费用 = 赎回金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费用

六、基金的投资目标和投资范围

一、基金的投资目标

在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。

二、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、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、可转换债券（含可分离交易可转债）、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。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购或增发。本基金通过可分离交易可转债认购所获得的认股权证，在其可上市交易后 10 个交易日内全部卖出。本基金所持可转换债券转股获得的股票在其可上市交易后的 10 个交易日内全部卖出。

本基金的投资组合比例为：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%。

未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单的，本基金可在履行适当程序后，参与同业存单的投资，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

七、基金的投资策略

在资本市场国际化的背景下，通过研判债券市场风险收益特征的国际化趋势和国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势，采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，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，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。

1、类属配置策略

在保证流动性的基础上，本基金将通过国债、央行票据、金融债、企业信用债、可转换债券、资产支持证券、银行存款、债券回购等资产的合理组合实现稳定的投资收益。

（1）相对价值策略

相对价值策略包括研究国债与金融债之间的信用利差、交易所与银行间的市场利差，寻找价值相对低估的投资品种。

（2）信用利差策略

通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断主动采用相对利差投资

策略。

2、期限结构策略

(1) 久期调整策略

本基金将根据对利率水平的预期，确定资产组合的久期配置。

(2) 收益率曲线策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化情景的分析，分别采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行合理配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

(3) 骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，随着基金持有债券时间的延长，债券的剩余期限将缩短，到期收益率将下降，基金从而可获得资本利得收入。

3、个券选择策略

(1) 流动性策略

通过对流动性做针对性地分析，考察个券的流动性。

(2) 信用分析策略

本基金对企业债、公司债、中期票据、金融债、短期融资券等信用债券进行信用分析。此分析主要通过三个角度完成：a, 独立第三方的外部评级结果；b, 质押或第三方担保等增信情况；c, 基于基本面财务模型的内部评价。基本面财务模型在信用评价的主要作用在于通过对部分关键的财务指标分析判断发行债券企业未来出现偿债风险的可能性，从而确定该企业发行债券的信用等级与利率水平。主要关键的指标包括：NET DEBT/EBITDA、EBIT/I、资产负债率、流动资产/流动负债、经营活动现金流/总负债。其中资产负债率、流动资产/流动负债主要分析企业静态的债务水平与结构，其他的指标主要分析企业经营效益对未来偿债能力的支持能力。

4、债券回购策略

本基金在基础组合的基础上，使用基础组合持有的债券进行回购融入短期资金滚动操作，投资于收益率高于融资成本的其它获利机会，从而获得杠杆放大收益。

5、中期票据投资策略

遴选收益风险平衡或被市场错误定价的中期票据，兼顾流动性，以持有到期为主，波段操作结合的方式进行中期票据的投资。

6、流动性管理策略

根据基金申购、赎回等情况，对投资组合进行流动性管理，确保基金资产的变现能力。

7、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券由于该券种的发行主体资质相对较弱，且存在信息透明度较低等问题，因而面临更大的信用风险，属于高风险高收益品种，未来有可能出现债券到期后企业不能按时清偿债务的情况，从而导致基金资产的损失。

本基金将从发行主体所处行业的稳定性、未来成长性，以及企业经营、现金流状况、抵质押及担保增信措施等方面优选信用资质相对较强的高收益债进行投资。严格执行分散化投资策略，分散行业、发行人和区域集中度，以避免行业或区域性事件对组合造成的集体冲击。

8、资产支持证券投资策略

本基金通过分析资产支持证券对应资产池的资产特征，来估计资产违约风险和提前偿付风险，根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流支付，并利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。同时还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，控制资产支持证券投资的风险，以获取较高的投资收益。

八、基金的投资限制

一、基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；
- (2) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- (3) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (9) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(11) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(13) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(14) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、债券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

二、为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事可能使基金承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用本基金，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

九、业绩比较基准

同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)

本基金在每一年的 1 月 1 日根据中国人民银行网站上发布并执行的一年期定期存款基准利率为标准进行每年更新。

本基金为低预期风险的纯债债券型基金，以银行一年期定期存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收

益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场中出现更适用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金可以在征得基金托管人同意后报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、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。

十一、基金投资组合报告（未经审计）

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，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。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 9 月 30 日。

1. 报告期末基金资产组合情况

■

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

■

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

■

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

10. 投资组合报告附注

10.1 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。

10.2 其他资产构成

■

10.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

■

10.4 报告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。

10.5 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。

十二、 基金的业绩

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。

历史时间段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

圆信永丰纯债 A

■

圆信永丰纯债 C

■

十三、 基金的费用

一、 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金 C 类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用（包括但不限于会议场地费、律师费、审计费

等)；

7、基金的证券交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金的证券账户开户费用、账户维护费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的市场推广、销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费、基金托管费和销售服务费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

十四、其他应披露事项

■

十五、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对圆信永丰纯债债券型证券投资基金招募说明书的内容进行了更新，招募说明书更新（2016 年第 2 号）的主要更新内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据和净值表现的截止日期。
- 2、在“第三部分 基金管理人”部分，更新了基金管理人的主要人员信息。
- 3、在“第四部分 基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关信息。
- 4、在“第五部分 相关服务机构”部分，更新了审计基金财产的会计师事务所

所信息，更新和新增了相关的其他销售机构信息，新增销售机构事宜已公告。

5、在“第九部分 基金的投资”部分，对“十、基金投资组合报告（未经审计）”和“十一、基金的业绩”的信息进行更新，有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日（未经审计）。

6、在“第二十一部分 其他应披露事项”部分，更新了本基金及本基金管理人的相应披露事项。

圆信永丰基金管理有限公司

二〇一七年一月十四日