

# 圆信永丰兴利债券型证券投资基金 2016 年年度报告

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 重要提示及目录

### 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 2 月 23 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
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.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
8.5 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.....	41
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
8.7 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.....	42

8.8 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 .....	42
8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
8.10 投资组合报告附注 .....	42
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>43</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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 .....	43
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>44</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>44</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
11.4 基金投资策略的改变 .....	44
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	45
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
11.8 其他重大事件 .....	46
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录 .....	47
12.2 存放地点 .....	47
12.3 查阅方式 .....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	圆信永丰兴利债券型证券投资基金	
基金简称	圆信永丰兴利	
基金主代码	001918	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年2月23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	1,821,593,774.19份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	圆信永丰兴利 A	圆信永丰兴利 C
下属分级基金的交易代码:	001918	001919
报告期末下属分级基金的份额总额	1,820,812,007.20份	781,766.99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，在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，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
	联系电话	021-60366000
	电子邮箱	service@gtsfund.com.cn
客户服务电话	4006070088	95561
传真	021-60366006	021-62159217
注册地址	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402单元之175	福州市湖东路154号
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	上海市江宁路168号兴业大厦 20楼

邮政编码	200122	200041
法定代表人	洪文瑾	高建平

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	圆信永丰基金管理有限公司	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 2 月 23 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日		2015 年		2014 年	
	圆信永丰兴利 A	圆信永丰兴利 C	圆信永丰兴利 A	圆信永丰兴利 C	圆信永丰兴利 A	圆信永丰兴利 C
本期已实现收益	52,009,121.04	34,608.52	-	-	-	-
本期利润	11,692,538.97	12,071.13	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0071	0.0105	-	-	-	-
本期加权平均净值利润率	0.70%	1.03%	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	1.20%	1.00%	-	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
期末可供分配利润	22,335,254.35	7,821.93	-	-	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0123	0.0100	-	-	-	-
期末基金资产净值	1,843,147,261.55	789,588.92	-	-	-	-

期末基金份额净值	1.012	1.010	-	-	-	-
3.1.3 累计期末指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
基金份额累计净值增长率	1.20%	1.00%	-	-	-	-

## 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

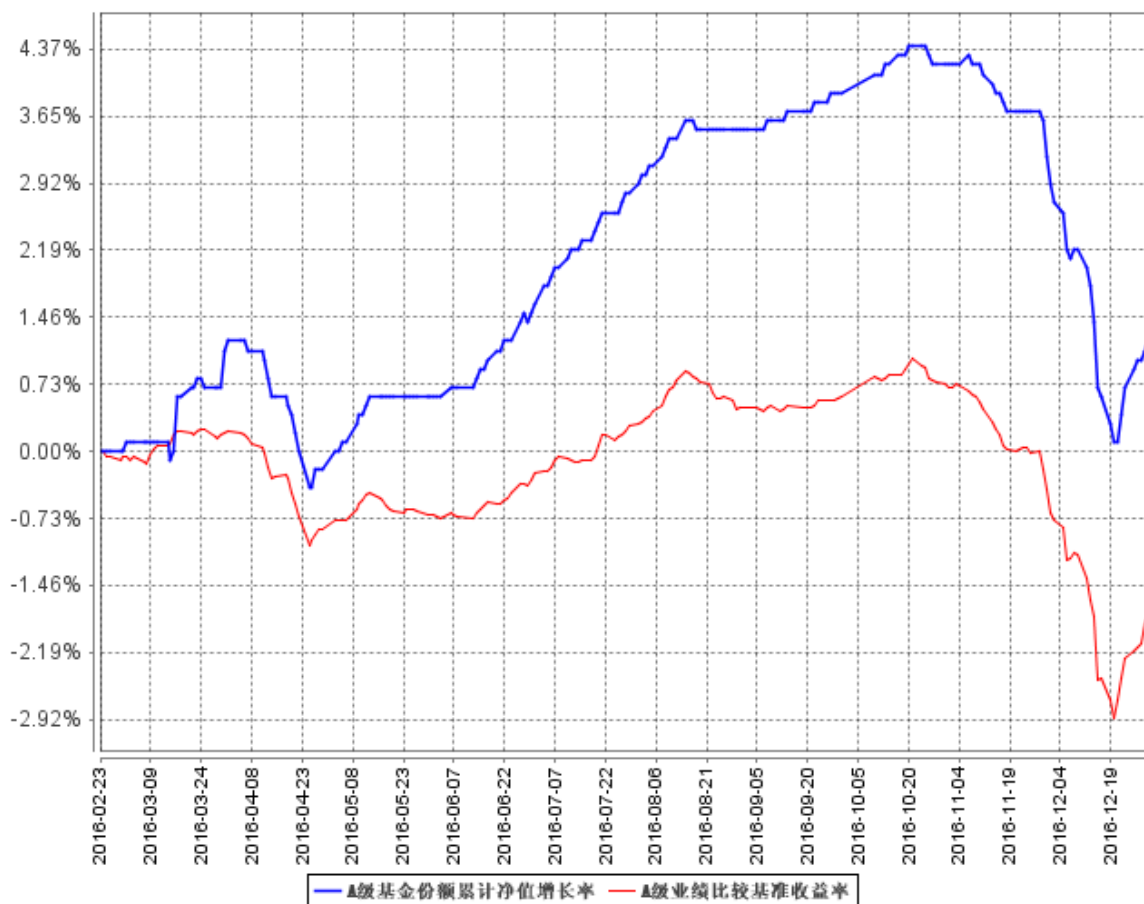
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.60%	0.16%	-2.32%	0.15%	-0.28%	0.01%
过去六个月	-0.30%	0.13%	-1.42%	0.11%	1.12%	0.02%
自基金合同生效起至今	1.20%	0.12%	-1.74%	0.09%	2.94%	0.03%

圆信永丰兴利 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	-2.60%	0.16%	-2.32%	0.15%	-0.28%	0.01%
过去六个月	-0.49%	0.12%	-1.42%	0.11%	0.93%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.00%	0.12%	-1.74%	0.09%	2.74%	0.03%

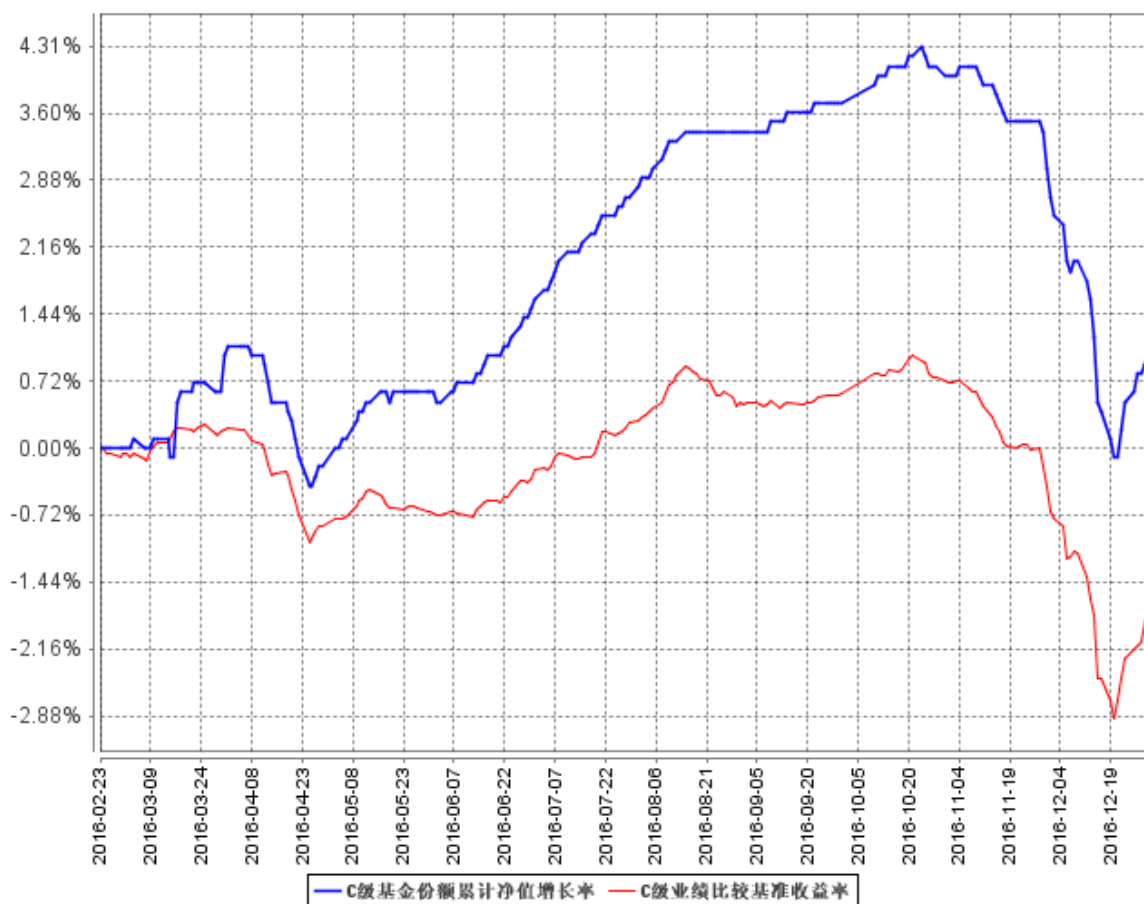
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



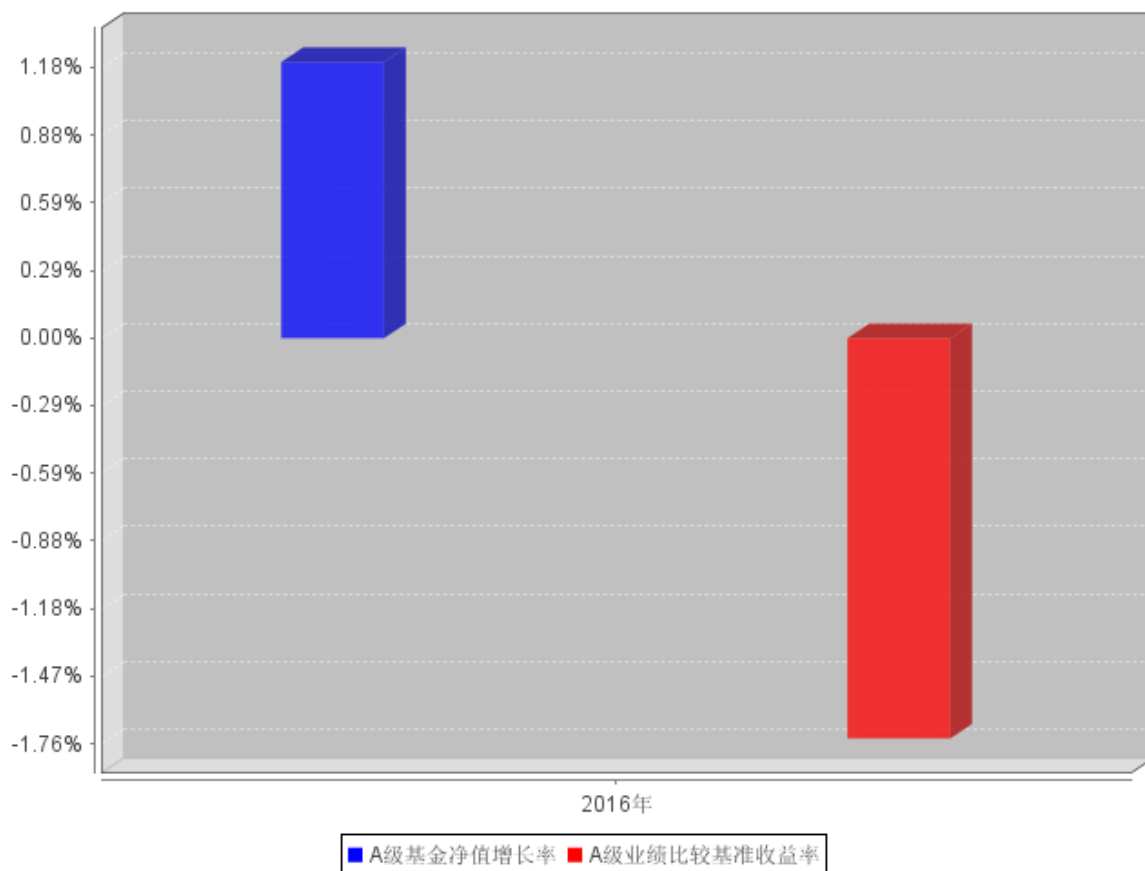


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

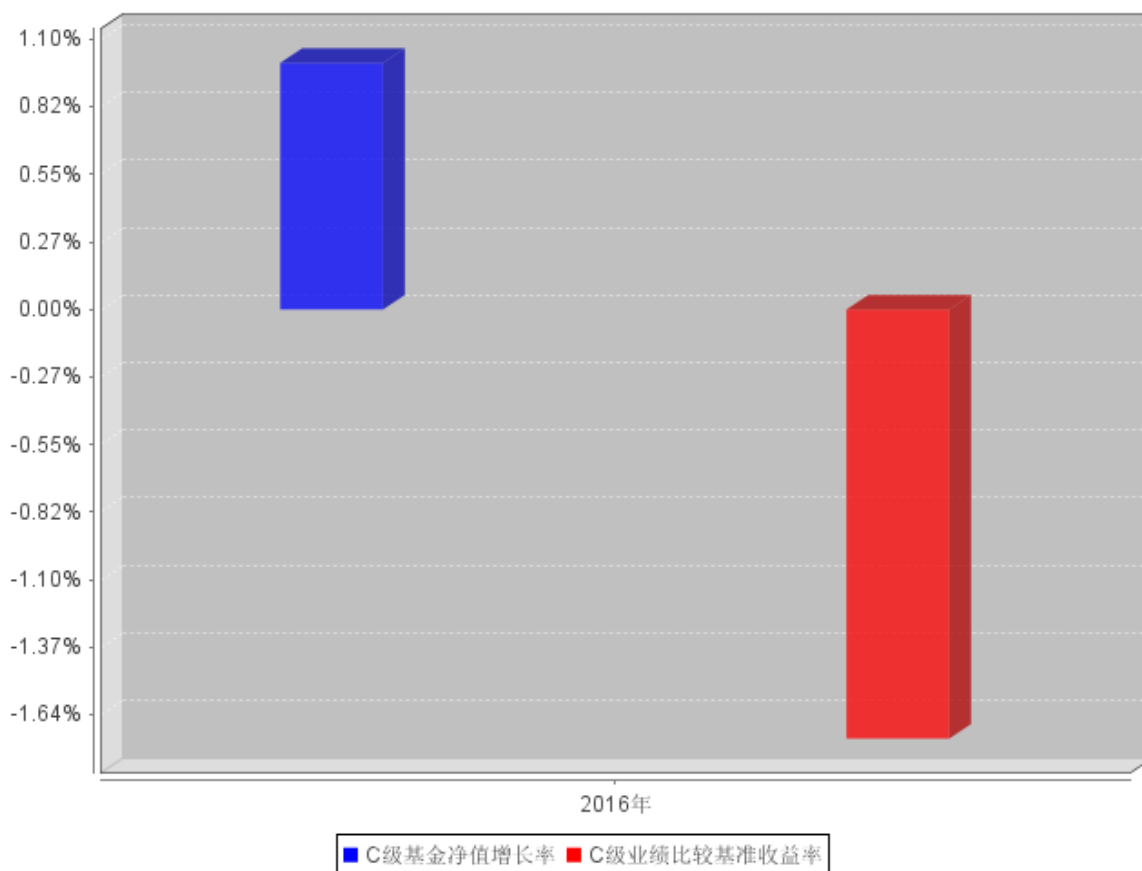


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

**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 1：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，公司旗下共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	2016年2月23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、《圆信永丰兴利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对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：1.012 元（累计净值：1.012 元），报告期内净值增长率：1.20%，高于业绩比较基准 2.94%；C 类份额净值：1.010 元（累计净值：1.010 元），报告期内净值增长率：1.00%，高于业绩比较基准 2.74%。

## 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 and 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

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，不存在损害本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 20213 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	圆信永丰兴利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利债券型证券投资基金(以下简称“圆信永丰兴利债券基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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利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: (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

	<p>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。</p> <p>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。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述圆信永丰兴利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利债券基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
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：圆信永丰兴利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 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	5,668,130.02
结算备付金		529,673.59
存出保证金		2,257.15
交易性金融资产	7.4.7.2	1,777,422,480.60
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,777,422,480.60
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	8,000,000.00
应收证券清算款		-

应收利息	7.4.7.5	53,819,859.67
应收股利		-
应收申购款		10,000.00
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,845,452,401.03
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		519,097.44
应付管理人报酬		627,655.49
应付托管费		235,370.78
应付销售服务费		274.61
应付交易费用	7.4.7.7	3,152.24
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	130,000.00
负债合计		1,515,550.56
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,821,593,774.19
未分配利润	7.4.7.10	22,343,076.28
所有者权益合计		1,843,936,850.47
负债和所有者权益总计		1,845,452,401.03

注:1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日,圆信永丰兴利债券型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.012 元,圆信永丰兴利债券型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.010 元,基金份额总额 1,821,593,774.19 份,其中 A 类基金份额 1,820,812,007.20 份,C 类基金份额 781,766.99 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体:圆信永丰兴利债券型证券投资基金

本报告期:2016 年 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期
-----	-----	----

		2016年2月23日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
<b>一、收入</b>		20,041,266.94
1.利息收入		58,922,636.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	205,110.13
债券利息收入		57,613,418.72
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,104,107.93
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,453,317.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	1,453,317.04
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-40,339,119.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	4,432.58
<b>减：二、费用</b>		8,336,656.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,768,353.69
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,163,132.53
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,985.72
4. 交易费用	7.4.7.19	8,581.92
5. 利息支出		232,697.94
其中：卖出回购金融资产支出		232,697.94
6. 其他费用	7.4.7.20	159,905.04
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		11,704,610.10
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		11,704,610.10

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：圆信永丰兴利债券型证券投资基金

本报告期：2016年2月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016年2月23日(基金合同生效日)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)	252,892,483.82	-	252,892,483.82

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,704,610.10	11,704,610.10
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）	1,568,701,290.37	10,638,466.18	1,579,339,756.55
其中：1. 基金申购款	1,591,551,710.85	11,179,801.33	1,602,731,512.18
2. 基金赎回款	-22,850,420.48	-541,335.15	-23,391,755.63
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）	1,821,593,774.19	22,343,076.28	1,843,936,850.47

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：

<u>董晓亮</u>	<u>于娟</u>	<u>虞俏依</u>
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

圆信永丰兴利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]2209号《关于准予圆信永丰兴利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《圆信永丰兴利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252,865,448.62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(2016)第202号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《圆信永丰兴利债券型证券投资基金基金合同》于2016年2月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为252,892,483.82份基金份额,其中认购资金利息折合27,035.20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《圆信永丰兴利债券型证券投资基金基金合同》和《圆信永丰兴利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《圆信永丰兴利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、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》、《圆信永丰兴利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 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图

和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：

- (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- (2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最

近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值；

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值；

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。



应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- (1) 对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务

的指导意见》提供的现金流量折现法等估值技术进行估值；

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供；

(3) 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)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2016 年 12 月 31 日	
活期存款	5,668,130.02	
定期存款	-	
其他存款	-	
合计：	5,668,130.02	

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2016 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	18,508,997.70	18,483,304.00	-25,693.70
	银行间市场	1,799,252,602.36	1,758,939,176.60	-40,313,425.76
	合计	1,817,761,600.06	1,777,422,480.60	-40,339,119.46
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,817,761,600.06	1,777,422,480.60	-40,339,119.46	

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末	
	2016 年 12 月 31 日	

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	8,000,000.00	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	8,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应收活期存款利息	859.67
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	238.40
应收债券利息	53,812,929.40
应收买入返售证券利息	5,831.20
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.00
合计	53,819,859.67

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	3,152.24
合计	3,152.24

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
预提信息披露费	70,000.00
预提审计费	60,000.00
合计	130,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

圆信永丰兴利 A		
项目	本期 2016年2月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	251,437,138.53	251,437,138.53
本期申购	1,589,815,907.70	1,589,815,907.70
本期赎回(以“-”号填列)	-20,441,039.03	-20,441,039.03
本期末	1,820,812,007.20	1,820,812,007.20

金额单位：人民币元

圆信永丰兴利 C		
项目	本期 2016年2月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,455,345.29	1,455,345.29
本期申购	1,735,803.15	1,735,803.15
本期赎回(以“-”号填列)	-2,409,381.45	-2,409,381.45
本期末	781,766.99	781,766.99

注：1. 本基金自 2016 年 2 月 1 日至 2016 年 2 月 19 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 252,865,448.62 元，折合为 252,865,448.62 份基金份额(其中 A 类基金份额为 251,410,255.50 份；C 类基金份额为 1,455,193.12 份)。根据《圆信永丰兴利债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金募集期内认购资金产生的利息收入计 27,035.20 元，折算为计 27,035.20 份基金份额(其中 A 类基金份额为 26,883.03 份，C 类基金份额为 152.17 份)，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《圆信永丰兴利债券型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2016 年 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 3 月 8 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务自 2016 年 3 月 9 日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

圆信永丰兴利 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

基金合同生效日	-	-	-
本期利润	52,009,121.04	-40,316,582.07	11,692,538.97
本期基金份额交易产生的变动数	5,528,240.70	5,114,474.68	10,642,715.38
其中：基金申购款	6,037,920.04	5,109,704.97	11,147,625.01
基金赎回款	-509,679.34	4,769.71	-504,909.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,537,361.74	-35,202,107.39	22,335,254.35

单位：人民币元

圆信永丰兴利 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	34,608.52	-22,537.39	12,071.13
本期基金份额交易产生的变动数	-11,720.36	7,471.16	-4,249.20
其中：基金申购款	20,021.42	12,154.90	32,176.32
基金赎回款	-31,741.78	-4,683.74	-36,425.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,888.16	-15,066.23	7,821.93

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	193,312.05
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,730.56
其他	67.52
合计	205,110.13

#### 7.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,453,317.04
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,453,317.04

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	102,836,380.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	87,954,758.96
减：应收利息总额	13,428,304.00
买卖债券差价收入	1,453,317.04

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年2月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-40,339,119.46
——股票投资	-
——债券投资	-40,339,119.46
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	-40,339,119.46

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	4,432.58
合计	4,432.58

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	66.92
银行间市场交易费用	8,515.00
合计	8,581.92

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	70,000.00
交易费用	2,205.00
账户服务费	21,205.00
银行划款手续费	6,495.04
合计	159,905.04

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

1. 本基金的基金管理人于 2017 年 1 月 16 日宣告 2017 年度第一次分红，向截至 2017 年 1 月 18 日止在本基金注册登记人圆信永丰基金管理有限公司登记在册的 A 类份额持有人，按每 10 份



基金份额派发红利 0.15 元，C 类份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.13 元。

2. 财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。截至本财务报表批准报出日止，上述税收政策对本基金截止 2016 年 12 月 31 日止年度/期间的财务状况和经营成果无影响。

#### 7.4.9 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
兴业银行股份有限公司(“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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,768,353.69
其中：支付销售机构的客户维护费	3,657,892.11

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。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,163,132.53

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。

**7.4.10.2.3 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 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	圆信永丰兴利 A	圆信永丰兴利 C	合计
圆信永丰基金公司	-	91.41	91.41
兴业银行	-	2,554.85	2,554.85
合计	-	2,646.26	2,646.26

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

**7.4.10.3 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。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金

**7.4.10.4.2 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

圆信永丰兴利 A	
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
兴业银行	1,788,895,861.97	98.2471%

#### 7.4.10.5 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2月23日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	5,668,130.02	193,312.05

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

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

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 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。

###### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。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、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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在追求本金安全、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。

本基金的基金管理人实行全面风险管理与全员风险管理。基金管理人以各岗位目标责任制为基础的第一道内控防线，员工在自律的前提下，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，各岗位人员在授权范围内承担责任；以相关部门、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部门及岗位负有监督责任；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；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规性实行全面监督重点反馈的第四道防线，风险管理委员会对公司经营和基金作中的风险进行严格的合规检查和风险控制评估后反馈董事会。董事会对基金管理人的风险管理负有最终责任。

本基金的基金管理人建立科学严密的风险评估体系，对内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险；建立完整的风险控制程序，包括风险识别、风险评估、风险控制和风险监控；对各部门和各业务循环存在的风险点进行识别评估，并建立相应的控制措施；使用科学的风险量化技术和严格的风险限额控制对投资风险实行定量分析和管理的。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行兴业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行

的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	66,811,635.40
合计	66,811,635.40

注：未评级部分为国债、央票、政策性金融债。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年12月31日
AAA	138,875,200.00
AAA 以下	1,113,233,976.60
未评级	458,501,668.60
合计	1,710,610,845.20

注：未评级部分为国债、央票、政策性金融债。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购

赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,668,130.02	-	-	-	5,668,130.02
结算备付金	529,673.59	-	-	-	529,673.59
存出保证金	2,257.15	-	-	-	2,257.15
交易性金融资产	335,388,280.60	531,472,200.00	910,562,000.00	-	1,777,422,480.60

买入返售金融资产	8,000,000.00	-	-	-	8,000,000.00
应收利息	-	-	-	53,819,859.67	53,819,859.67
应收申购款	-	-	-	10,000.00	10,000.00
资产总计	349,588,341.36	531,472,200.00	910,562,000.00	53,829,859.67	1,845,452,401.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	519,097.44	519,097.44
应付管理人报酬	-	-	-	627,655.49	627,655.49
应付托管费	-	-	-	235,370.78	235,370.78
应付销售服务费	-	-	-	274.61	274.61
应付交易费用	-	-	-	3,152.24	3,152.24
其他负债	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	-	-	-	1,515,550.56	1,515,550.56
利率敏感度缺口	349,588,341.36	531,472,200.00	910,562,000.00	52,314,309.11	1,843,936,850.47

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末（2016年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加约 1,438
	2. 市场利率上升 25 个基点	减少约 1,419

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.14 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 1,777,422,480.60 元，无属于第一层次及第三层次的余额。

(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。

(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	1,777,422,480.60	96.31



	其中：债券	1,777,422,480.60	96.31
	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	8,000,000.00	0.43
	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	6,197,803.61	0.34
7	其他各项资产	53,832,116.82	2.92
8	合计	1,845,452,401.03	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 8.4 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	18,483,304.00	1.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	506,830,000.00	27.49
	其中：政策性金融债	506,830,000.00	27.49
4	企业债券	1,134,001,176.60	61.50
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	118,108,000.00	6.41
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,777,422,480.60	96.39

## 8.5 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	160407	16 农发 07	3,000,000	290,520,000.00	15.76
2	1680076	16 柳州投控债	1,800,000	177,192,000.00	9.61
3	1680082	16 建安债	1,500,000	147,780,000.00	8.01

4	1280027	12 葫芦岛债	1,000,000	105,110,000.00	5.70
5	1680244	16 浏阳城建债	1,000,000	99,030,000.00	5.37

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 8.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 投资组合报告附注

#### 8.10.1

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。

#### 8.10.2

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。

#### 8.10.3 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	2,257.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	53,819,859.67
5	应收申购款	10,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,832,116.82

**8.10.4 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。

**8.10.5 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。

**8.10.6 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
圆信永丰兴利 A	260	7,003,123.10	1,788,895,861.97	98.25%	31,916,145.23	1.75%
圆信永丰兴利 C	146	5,354.57	-	-	781,766.99	100.00%
合计	406	4,486,684.17	1,788,895,861.97	98.20%	32,697,912.22	1.80%

**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	圆信永丰兴利 A	-	-
	圆信永丰兴利 C	2,100.80	0.2687%
	合计	2,100.80	0.0001%

**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	圆信永丰兴利 A	0
	圆信永丰兴利 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	圆信永丰兴利 A	0
	圆信永丰兴利 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	圆信永丰兴利 A	圆信永丰兴利 C
基金合同生效日（2016 年 2 月 23 日）基金份额总额	251,437,138.53	1,455,345.29
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,589,815,907.70	1,735,803.15
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	20,441,039.03	2,409,381.45
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,820,812,007.20	781,766.99

## § 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

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 6 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	65,954,317.15	100.00%	1,710,946,000.00	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。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	圆信永丰兴利债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	证券日报	2016年3月7日
2	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下部分基金基金经理变更的公告	证券日报	2016年3月19日
3	圆信永丰基金管理有限公司关于圆信永丰兴利债券型证券投资基金限制大额申购的公告	证券日报	2016年4月1日
4	圆信永丰基金管理有限公司关于增聘圆信永丰纯债债券型证券投资基金、圆信永丰兴融债券型证券投资基金和圆信永丰兴利债券型证券投资基金基金经理的公告	证券日报	2016年4月12日
5	圆信永丰基金管理有限公司关于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开放上线的公告	证券日报	2016年7月1日
6	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下基金2016年上半年度资产净值的公告	证券日报	2016年7月1日
7	圆信永丰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报	2016年9月7日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

-
---

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准圆信永丰兴利债券型证券投资基金设立的文件；
2. 《圆信永丰兴利债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《圆信永丰兴利债券型证券投资基金托管协议》；
4. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人圆信永丰基金管理有限公司。

咨询电话：4006070088

公司网址：<http://www.gtsfund.com.cn>

圆信永丰基金管理有限公司  
2017年3月31日