

圆信永丰丰润货币市场基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：圆信永丰基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	丰润货币	
基金主代码	004178	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 10 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	2,792,910,557.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	丰润货币 A	丰润货币 B
下属分级基金的交易代码:	004178	004179
报告期末下属分级基金的份额总额	12,823,830.90 份	2,780,086,726.38 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将以价值分析为基础，宏观与微观、定性与定量相结合，通过专业的流动性管理力争为投资者实现资产的保值、增值。结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足流动性需要的基础上实现更高的收益率。
投资策略	本基金的投资将以保证资产的流动性为基本原则，力求在对国内外宏观经济走势、货币财政政策变动等因素充分评估的基础上，科学预计未来利率走势，择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具，进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	丰润货币 A	丰润货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 3 月 10 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 3 月 10 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	84,966.81	31,813,931.63
本期利润	84,966.81	31,813,931.63
本期净值收益率	1.2102%	1.2833%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	12,823,830.90	2,780,086,726.38
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	1.2102%	1.2833%

注 1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金按日结转份额。

4、本基金合同生效日为 2017 年 3 月 10 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

丰润货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④
----	----------	----------	----------	------------	-----	-----

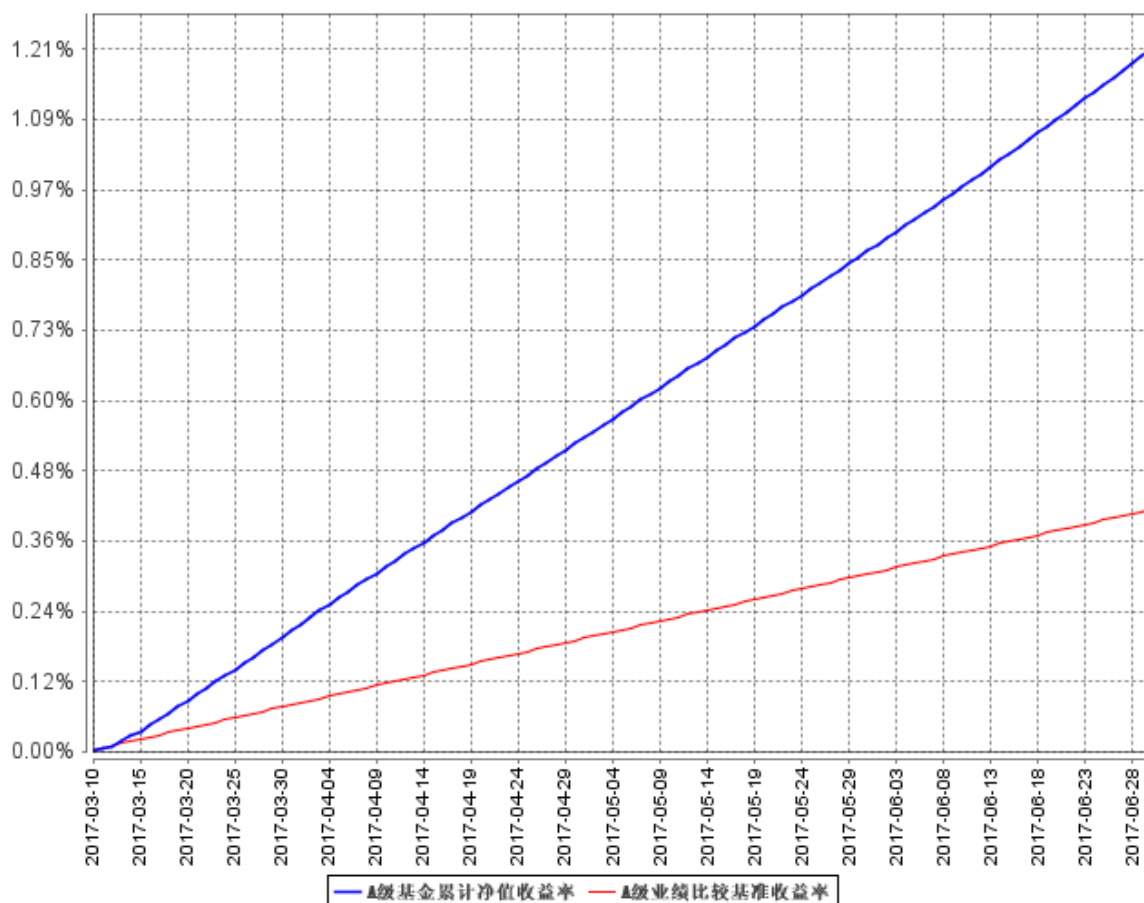
		准差②	率③	准差④		
过去一个月	0.3447%	0.0005%	0.1110%	0.0000%	0.2337%	0.0005%
过去三个月	0.9992%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.6626%	0.0005%
自基金合同生效起至今	1.2102%	0.0013%	0.4179%	0.0000%	0.7923%	0.0013%

丰润货币 B

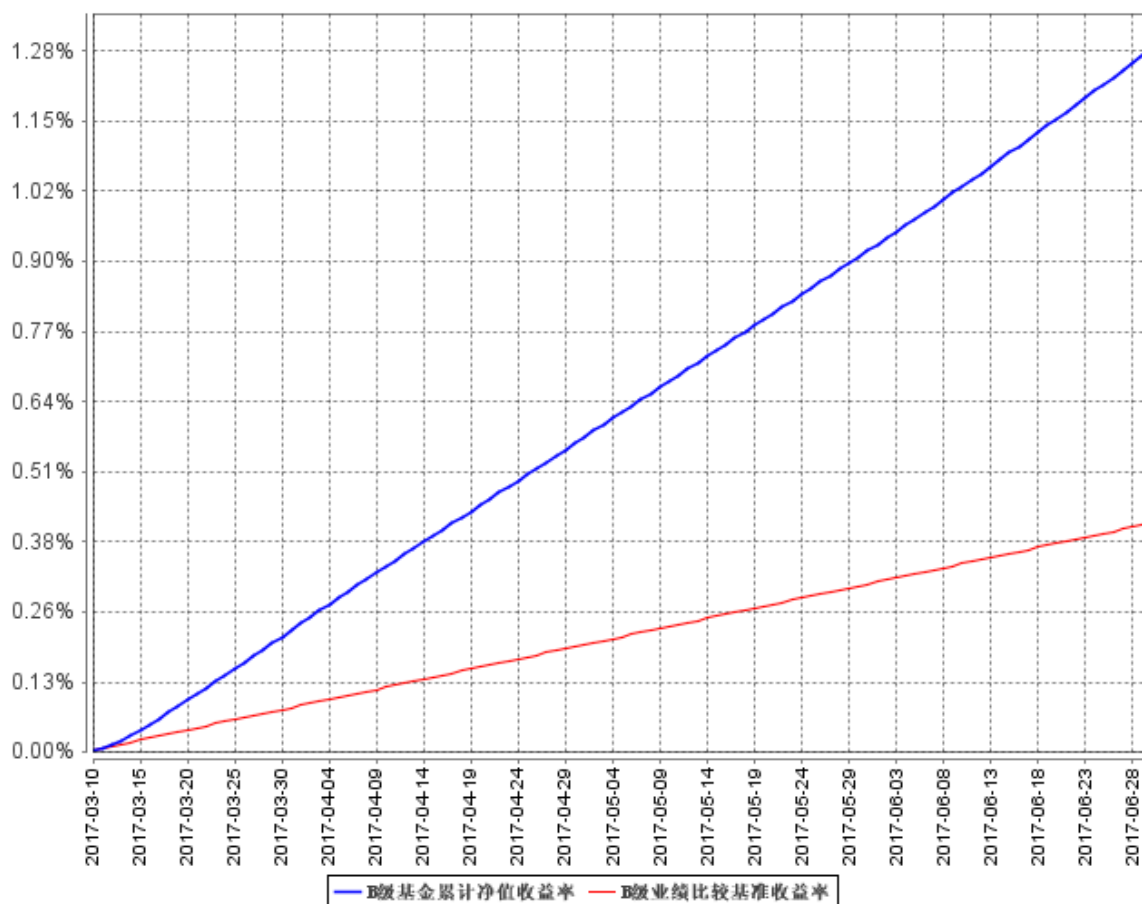
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3644%	0.0005%	0.1110%	0.0000%	0.2534%	0.0005%
过去三个月	1.0586%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.7220%	0.0005%
自基金合同生效起至今	1.2833%	0.0014%	0.4179%	0.0000%	0.8654%	0.0014%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注 1、本基金于 2017 年 3 月 10 日成立，截止报告期末，本基金成立不满一年。

注 2、根据基金合同，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截止报告期末尚处于建仓期。建仓期满，本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定。

§ 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 2017 年 6 月 30 日，公司旗下共管理九只开放式证券投资基金，分别为圆信永丰纯债债券型证券投资基金、圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金、圆信永丰优加生活股票型证

券投资基金、圆信永丰兴融债券型证券投资基金、圆信永丰兴利债券型证券投资基金、圆信永丰强化收益债券型证券投资基金、圆信永丰丰润货币市场基金、圆信永丰多策略精选混合型证券投资基金及圆信永丰兴源灵活配置混合型证券投资基金。

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		
林铮	本基金基金经理	2017年3月10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基金投资部下设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	本基金基金经理	2017年3月15日	-	7年	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。历任广州中大凯思投资集团投资部分析师、上海申银万国证券研究所债券高级分析师、中信证券股份有限公司资产管理部固定收益投资经理。
刘莎莎	本基金基金经理助理	2017年3月10日	-	7年	南京财经大学金融学硕士，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货币基金经理助理。历任江南农村商业银行公司业务部办事员、资金业务部业务主管、风险管理部业务主管。

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、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在风险可控的前提下为基金份额持有人谋求最大利益。基金经理对个券及投资组合的投资比例严格遵循法律法规、基金合同和公募基金投资决策委员会的授权限制。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和《圆信永丰基金管理有限公司公平交易管理办法》的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保基金管理人管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

基金管理人各类基金资产、特定资产管理计划资产独立运作。对于交易所市场投资，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照价格优先、时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资，基金管理人通过交易对手控制和询价机制，严格防范对手风险并抽检价格公允性；对于申购投资行为，基金管理人遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过每季度和每年度对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，基金管理人未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，基金管理人未发现存在有可能导致不公平交易和利益输送等的异常交易行为。

基金管理人旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

总体看，受央行货币政策转变和金融监管收紧影响，上半年利率债收益率曲线整体震荡走高，信用利差走阔，特别是二季度，短期资金成本上行显著，市场信用风险在整体货币供给充足下，维持相对平稳，但局部风险仍然较大。

本基金于 3 月份建仓，资产配置上以维持流动性安全和防范信用风险作为第一要务，整体资产剩余期限维持在较短范围内，并利用资金价格季度波动的特点，在临近半年末适度拉长久期，以保持整体基金的合理收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，丰润货币 A 的净值收益率为 1.2102%，丰润货币 B 的净值收益率为 1.2833%，同期业绩比较基准收益率均为 0.4179%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

地方债务融资收紧、基建投资增速下行以及库存周期的结束将对下半年宏观经济构成一定下行压力，但制造业投资、出口、消费的平稳将对经济形成支撑，下半年宏观经济下行压力有限。加强金融监管将是未来一段时间的主基调，对债市的影响会长期存在；人民币汇率企稳的背景下，货币政策将保持稳健中性。在人民币汇率企稳，货币政策保持稳健中性背景下，资金利率季节性波动仍将较为明显，控制组合的剩余期限，把握货币市场波动节奏将成为产品下半年投资的主要策略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并设立估值委员会具体负责监督执行。估值委员会的成员由首席投资官或其授权代表、清算登记部分管领导、研究部负责人、监察稽核部总监、清算登记部总监和相关基金会计组成。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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书等有关规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人，当日收益参与下一日的收益分配，并定期支付且结转为相应的基金份额。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：圆信永丰丰润货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款		1,417,034,983.26
结算备付金		25,000.00
存出保证金		9,985.99
交易性金融资产		986,659,014.70
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		986,659,014.70
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		516,007,420.99
应收证券清算款		-
应收利息		9,643,169.65
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		2,929,379,574.59
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 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		135,399,651.20

应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		447,874.78
应付托管费		111,968.74
应付销售服务费		24,750.83
应付交易费用		20,790.53
应交税费		-
应付利息		27,633.98
应付利润		362,306.16
递延所得税负债		-
其他负债		74,041.09
负债合计		136,469,017.31
所有者权益：		
实收基金		2,792,910,557.28
未分配利润		-
所有者权益合计		2,792,910,557.28
负债和所有者权益总计		2,929,379,574.59

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，丰润货币 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 12,823,830.90 份；丰润货币 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,780,086,726.38 份。圆信永丰丰润货币份额总额合计为 2,792,910,557.28 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：圆信永丰丰润货币市场基金

本报告期：2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		34,071,160.24
1.利息收入		34,060,293.47
其中：存款利息收入		22,858,211.85
债券利息收入		5,893,593.52
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		5,308,488.10
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,866.77
其中：股票投资收益		-

基金投资收益		-
债券投资收益		10,866.77
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-
减：二、费用		2,172,261.80
1. 管理人报酬		1,521,622.15
2. 托管费		380,405.58
3. 销售服务费		81,074.81
4. 交易费用		-
5. 利息支出		103,227.04
其中：卖出回购金融资产支出		103,227.04
6. 其他费用		85,932.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,898,898.44
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,898,898.44

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 10 日，本财务报表的实际编制期间为 2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日止期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：圆信永丰丰润货币市场基金

本报告期：2017 年 3 月 10 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,800,996,400.53	-	1,800,996,400.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	31,898,898.44	31,898,898.44

期净利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	991,914,156.75	-	991,914,156.75
其中：1.基金申购款	1,468,660,636.52	-	1,468,660,636.52
2.基金赎回款	-476,746,479.77	-	-476,746,479.77
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)	-	-31,898,898.44	-31,898,898.44
五、期末所有者权益(基金净值)	2,792,910,557.28	-	2,792,910,557.28

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 10 日，本财务报表的实际编制期间为 2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日止期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

圆信永丰丰润货币市场基金(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”)证监基金字[2016]第 3070 号《关于准予圆信永丰丰润货币市场基金注册的批复》核准，由圆信永丰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰丰润货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,800,940,379.00 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(2017)第 251 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《圆信永丰丰润货币市场基金基金合同》于 2017 年 3 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,800,996,400.53 份基金份额，其中认购资金利息折合 56,021.53 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(以下简称“兴业银行”)。

根据《圆信永丰丰润货币市场基金基金合同》和《圆信永丰丰润货币市场基金招募说明书》的规定，本基金根据销售服务费收取费率的不同将基金份额分为 A 类与 B 类份额。本基金两类

基金份额单独设置基金代码，并分别公布基金份额的每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率，不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰丰润货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为良好流动性的工具，包括现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：七天通知存款利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（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》、《圆信永丰丰润货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本报告期内无会计估计变更。

6.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.5 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[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。

6.4.6 关联方关系

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

无。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
圆信永丰基金管理有限公司（以下简称“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（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
永丰证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,521,622.15
其中：支付销售机构的客户维护费	127.93

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的 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	380,405.58

注：支付基金托管人兴业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

6.4.7.2.3 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		
	2017 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	丰润货币 A	丰润货币 B	合计
圆信永丰基金公司	4,801.93	75,873.00	80,674.93
兴业银行	399.88	-	399.88
合计	5,201.81	75,873.00	81,074.81

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 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。其计算公式为：

对应基金份额级别日销售服务费 = 前一日对应级别基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

6.4.7.3 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与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.7.4.2 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

丰润货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年6月30日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
-	-	-

丰润货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年6月30日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
兴业银行股份有限公司	506,199,760.61	18.2100%
兴业银行股份有限公司 厦门分行	1,822,918,195.30	65.5700%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

6.4.7.5 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 2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	5,034,983.26	374,346.01

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。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

注：报告期及上年度可比期间本基金无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.8 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：报告期末本基金未持有因暂时停牌等而流通受限的股票。

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 99,199,651.20 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
140438	14 农发 38	2017 年 7 月 6 日	100.06	200,000	20,011,170.84
150201	15 国开 01	2017 年 7 月 6 日	100.11	200,000	20,021,011.96
150414	15 农发 14	2017 年 7 月 6 日	99.40	300,000	29,818,519.71
170204	17 国开 04	2017 年 7 月 6 日	99.39	200,000	19,877,266.28
170408	17 农发 08	2017 年 7 月 6 日	99.54	100,000	9,954,328.06
合计				1,000,000	99,682,296.85

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 36,200,000.00 元，于 2017 年 7 月 24 日、2017 年 7 月 25 日和 2017 年 7 月 26 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.9 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 2017 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 986,659,014.70 元，无属于第一层次和第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变化。

(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 2017 年 06 月 30 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定：(a) 金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；(b) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(c) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 10 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	986,659,014.70	33.68
	其中: 债券	986,659,014.70	33.68
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	516,007,420.99	17.61
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,417,059,983.26	48.37
4	其他各项资产	9,653,155.64	0.33
5	合计	2,929,379,574.59	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.43	
	其中: 买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	135,399,651.20	4.85
	其中: 买断式回购融资	-	-

注: 本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注: 本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	72

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	77
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限（天数）	原因	调整期
----	------	------------	----	-----

注：根据本货币市场基金基金合同的约定，其投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 120 天。本报告期内，本货币市场基金投资组合平均剩余期限未发生超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	34.76	4.85
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	13.18	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	37.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	19.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.54	4.85

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	56,739,237.65	2.03

2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,682,296.85	3.57
	其中：政策性金融债	99,682,296.85	3.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	830,237,480.20	29.73
8	其他	-	-
9	合计	986,659,014.70	35.33
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111715190	17 民生银行 CD190	1,000,000	98,988,158.19	3.54
2	111715170	17 民生银行 CD170	900,000	89,188,487.58	3.19
3	111799908	17 北京农商银行 CD055	800,000	79,236,226.53	2.84
4	111796572	17 汉口银行 CD047	500,000	49,843,613.70	1.78
5	111796841	17 江苏江南农村商业银行 CD057	500,000	49,793,671.19	1.78
6	111793432	17 江西银行 CD034	500,000	49,507,131.83	1.77
7	111709250	17 浦发银行 CD250	500,000	49,471,552.25	1.77
8	111615323	16 民生 CD323	500,000	49,213,086.45	1.76
9	111711275	17 平安银行 CD275	500,000	48,903,306.17	1.75
10	111714183	17 江苏银行 CD183	500,000	48,894,457.68	1.75

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0336%
报告期内偏离度的最低值	-0.0125%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0056%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注**7.9.1**

鉴于货币市场基金的特性，本基金采用摊余成本法计算基金资产净值，即本基金按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价，以摊余的成本计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人采用“影子定价”，即于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估，当基金资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至 1.00 元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

7.9.2

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。

7.9.3 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	9,985.99

2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,643,169.65
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,653,155.64

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	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
丰润货币 A	319	40,200.10	7,891,443.12	61.54%	4,932,387.78	38.46%
丰润货币 B	14	198,577,623.31	2,729,957,385.14	98.20%	50,129,341.24	1.80%
合计	333	8,387,118.79	2,737,848,828.26	98.03%	55,061,729.02	1.97%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	丰润货币 A	1,502,912.64	11.7197%
	丰润货币 B	-	-
	合计	1,502,912.64	0.0538%

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。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	丰润货币 A	10~50
	丰润货币 B	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	丰润货币 A	0
	丰润货币 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	丰润货币 A	丰润货币 B
基金合同生效日（2017 年 3 月 10 日）基金份额总额	940,400.53	1,800,056,000.00
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	13,594,199.05	1,455,066,437.47
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,710,768.68	475,035,711.09
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	12,823,830.90	2,780,086,726.38

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内基金新增 10 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，东兴证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，浙商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
 - (5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员；
 - (6) 具备较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较强的研究综合实力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、策略、行业、个股分析的报告及丰富全面的信息服
- 务；合作机构研究强项与我司研究重点匹配度高，能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他业务的开展提供良好的服务和支持。

3、基金选择证券公司交易单元的选择程序如下：

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

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017 年 3 月 10 日至 2017 年 6 月 30 日	1,800,056,000.00	22,862,195.30	-	1,822,918,195.30	65.27
	2	2017 年 3 月 15 日至 2017 年 5 月 8 日、2017 年 5 月 17 日至 2017 年 5 月 22 日	500,000,000.00	6,199,760.61	-	506,199,760.61	18.12
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无。

圆信永丰基金管理有限公司
2017年8月29日