圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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 1 月 1 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	圆信永丰双红利	
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	1,490,332,804.20 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	圆信永丰双红利 A	圆信永丰双红利 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	1,339,713,452.33 份	150,619,351.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过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	圆信永丰双红利 A	圆信永丰双红利 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	73,102,244.65	6,441,530.05
本期利润	205,077,230.69	17,713,433.54
加权平均基金份额本期利润	0.1687	0.1681
本期基金份额净值增长率	14.55%	14.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1196	0.0996
期末基金资产净值	1,719,150,182.26	190,239,824.66
期末基金份额净值	1.283	1.263

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

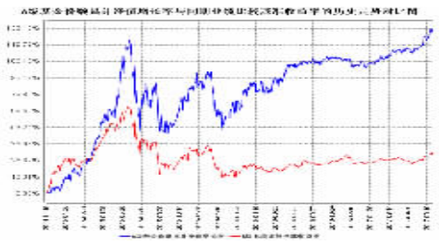
圆信永丰双红利 A

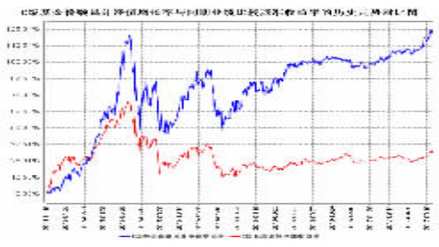
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.74%	0.67%	3.75%	0.47%	2.99%	0.20%
过去三个月	8.73%	0.59%	3.98%	0.44%	4.75%	0.15%
过去六个月	14.55%	0.53%	6.78%	0.40%	7.77%	0.13%
过去一年	18.36%	0.56%	10.06%	0.48%	8.30%	0.08%
自基金合同生效起至今	132.93%	1.71%	32.21%	1.29%	100.72%	0.42%

圆信永丰双红利 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
过去一个月	6.67%	0.67%	3.75%	0.47%	2.92%	0.20%
过去三个月	8.51%	0.59%	3.98%	0.44%	4.53%	0.15%
过去六个月	14.09%	0.53%	6.78%	0.40%	7.31%	0.13%
过去一年	17.16%	0.56%	10.06%	0.48%	7.10%	0.08%
自基金合同生效起至今	124.88%	1.71%	32.21%	1.29%	92.67%	0.42%

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





§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”)正监许可[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%，注册资本或亿元人民币。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		
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	2017 年 6 月 2 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遵规守信情况的说明

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

报告期内，投资思路围绕两条主线展开，一个是配置重点为各个行业的龙头企业，国际化的背景下，原先龙头企业的估值折价可能转向估值溢价，估值逐步向海外接轨；一个是寻找确定性的增长，优选景气度高的行业和增长稳定的个股。重点规避估值偏高、增长主要来自外延扩张的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，圆信永丰双红利 A 的基金份额净值为 1.283 元(累计净值 2.042 元)，本报告期基金份额净值增长率为 14.55%；截至本报告期末，圆信永丰双红利 C 基金份额净值为 1.263 元（累计净值 1.995 元），本报告期基金份额净值增长率为 14.09%；圆信永丰双红利 A、C 类的同期业绩比较基准收益率均为 6.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一、二季度的宏观经济数据超出了市场预期，海外宏观经济平稳，国内大宗商品价格保持了极强的韧性。展望下半年，需要关注两条主线的影响：一是金融去杠杆对企业和政府投资的影响，从月度社融数据来看，企业获取的信贷难以对冲社融规模的下降。二是棚改货币化、地方政府投资放缓可能带来的影响。我们对经济的判断是经济增速可能略有下滑。

证券市场上，我们最为关注市场流动性萎缩带来的冲击，流动性缓慢萎缩和 IPO 大量发行造成了部分股票成交量低迷，流动性风险需要重视。

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。

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；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。

4.7 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。

4.8 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

本报告期内，本基金托管人在对圆信永丰双红利灵活配置混合型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，圆信永丰双红利灵活配置混合型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红利灵活配置混合型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，圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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红利灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		17,030,950.77	45,381,858.47
结算备付金		27,163,244.29	22,025,523.69
存出保证金		448,193.59	494,217.44
交易性金融资产		1,587,170,761.37	1,331,640,869.03
其中：股票投资		1,397,471,761.37	1,119,713,347.33
基金投资		-	-
债券投资		189,699,000.00	211,927,521.70
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		250,000,000.00	50,000,000.00
应收证券清算款		30,074,276.11	40,029,677.79
应收利息		1,265,665.24	2,910,322.30
应收股利		-	-
应收申购款		12,086,518.13	3,639,710.56
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,925,239,609.50	1,496,122,179.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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
应付赎回款		8,762,509.70	3,019,716.77
应付管理人报酬		2,166,201.56	1,899,395.75
应付托管费		361,033.58	316,565.96
应付销售服务费		102,507.16	56,545.06
应付交易费用		4,289,221.16	1,313,207.77
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		168,129.42	164,371.24
负债合计		15,849,602.58	9,380,531.23
所有者权益：			
实收基金		1,490,332,804.20	1,328,399,051.74
未分配利润		419,057,202.72	158,342,596.31
所有者权益合计		1,909,390,006.92	1,486,741,648.05
负债和所有者权益总计		1,925,239,609.50	1,496,122,179.28

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，圆信永丰双红利 A 类的基金份额净值 1.283 元，基金份额总额 1,339,713,452.33 份；圆信永丰双红利 C 类的基金份额净值 1.263 元，基金份额总额 150,619,351.87 份。圆信永丰双红利份额总额合计为 1,490,332,804.20 份。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		243,992,631.66	54,837,044.21
1.利息收入		6,076,347.53	945,649.09
其中：存款利息收入		301,814.82	327,441.61
债券利息收入		3,329,377.85	420,820.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,445,154.86	197,386.57
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		93,722,634.70	10,163,793.35
其中：股票投资收益		84,246,676.73	4,738,379.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益		559,129.12	232,781.52
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		8,916,828.85	5,192,632.75
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		143,246,889.53	42,403,048.69
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		946,759.90	1,324,553.08
减：二、费用		21,201,967.43	10,331,185.36
1. 管理人报酬		11,524,431.51	5,035,135.21
2. 托管费		1,920,738.55	839,189.30
3. 销售服务费		482,970.41	217,960.94
4. 交易费用		7,171,938.69	4,150,466.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		101,888.27	88,433.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		222,790,664.23	44,505,858.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		222,790,664.23	44,505,858.85

6.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 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)	1,328,399,051.74	158,342,596.31	1,486,741,648.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	222,790,664.23	222,790,664.23
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）	161,933,752.46	37,923,942.18	199,857,694.64
其中：1.基金申购款	622,769,507.32	123,130,229.61	745,899,736.93
2.基金赎回款	-460,835,754.86	-85,206,287.43	-546,042,042.29
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)	1,490,332,804.20	419,057,202.72	1,909,390,006.92

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	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)	-	44,505,858.85	44,505,858.85
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）	537,044,546.34	-65,558.02	536,978,988.32
其中：1.基金申购款	814,324,701.43	5,772,098.02	820,096,799.45
2.基金赎回款	-277,280,155.09	-5,837,656.04	-283,117,811.13
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)	1,001,492,996.31	84,044,988.82	1,085,537,985.13

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：

董晓亮 于娟 虞俏依

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金(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[2014]928 号《关于准予圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《圆信永丰双红利灵活配置混合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 1,027,978,397.62 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(2014)第 683 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,028,182,938.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 204,540.74 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《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《圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金自募集期起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，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别，但不同基金份额类别之间不能相互转换。

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的相关规定)。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)投资比例为基金资产的 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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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 8 月 29 日批准报出。

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 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 1 月 1 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 1 月 1 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金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[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股票、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，股权的股息、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。

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（“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 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,524,431.51	5,035,135.21
其中：支付销售机构的客户维护费	4,907,686.75	2,319,331.67

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 1.5% 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 × 1.5% / 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 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,920,738.55	839,189.30

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。

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 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	圆信永丰双红利 A	圆信永丰双红利 C	合计
圆信永丰基金公司	-	328,870.36	328,870.36
中国工商银行	-	101,809.75	101,809.75
合计	-	430,680.11	430,680.11

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	圆信永丰双红利 A	圆信永丰双红利 C	合计
圆信永丰基金公司	-	113,946.55	113,946.55
中国工商银行	-	65,763.20	65,763.20
合计	-	179,709.75	179,709.75

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 0.8% 的年费率计提，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。其计算公式为：

C 类基金份额日销售服务费=前一日的 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.8%/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发生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

注：报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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	17,030,950.77	165,702.91	15,177,267.85	293,402.05

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。

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

金额单位：人民币元

6.4.10.1.1 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 6 月 9 日	2017 年 6 月 9 日	非公开发行流通受限	11.82	13.43	1,184,433	13,999,998.06	15,906,935.19	-
002821	凯莱英	2016 年 11 月 11 日	2017 年 11 月 13 日	老配售股流通受限	30.53	72.97	42,818	653,616.77	3,124,429.46	-
603660	苏州科达	2016 年 11 月 21 日	2017 年 11 月 21 日	老配售股流通受限	8.03	40.95	26,007	208,836.21	1,064,986.65	-
600383	金辉花	2016 年 12 月 9 日	2017 年 12 月 11 日	老配售股流通受限	10.60	21.18	36,764	389,698.40	778,661.52	-
002859	洁美科技	2017 年 3 月 24 日	2018 年 3 月 26 日	老配售股流通受限	29.82	73.00	6,666	198,780.12	486,618.00	-
002860	星帅尔	2017 年 3 月 31 日	2018 年 4 月 2 日	老配售股流通受限	19.81	48.96	8,127	160,995.87	397,410.36	-
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	所有未市通限	股上流受