圆信永丰纯债债券型证券投资基金 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	圆信永丰纯债	
基金主代码	000629	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 5 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	
报告期末基金份额总额	102,463,981.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	圆信永丰纯债 A 类	圆信永丰纯债 C 类
下属分级基金的交易代码:	000629	000630
报告期末下属分级基金的份额总额	100,473,910.67 份	1,990,070.62 份

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	本基金将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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)。
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	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	圆信永丰纯债 A 类	圆信永丰纯债 C 类
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	1,413.84	-12,342.22
本期利润	2,192,573.90	31,394.06
加权平均基金份额本期利润	0.0188	0.0069
本期基金份额净值增长率	1.55%	1.46%
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	0.0481	0.0437
期末基金资产净值	105,308,015.96	2,077,012.38
期末基金份额净值	1.048	1.044

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

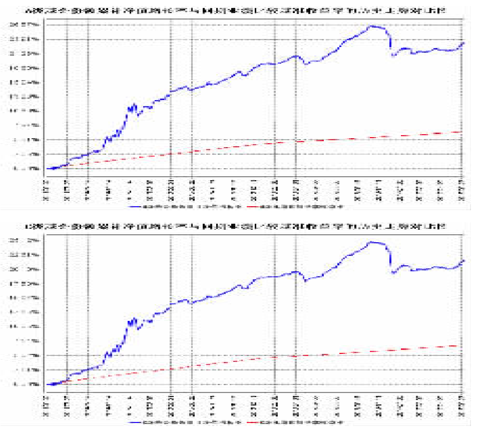
圆信永丰纯债 A 类

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	1.16%	0.06%	0.12%	0.00%	1.04%	0.06%
过去三个月	1.26%	0.07%	0.35%	0.00%	0.91%	0.07%
过去六个月	1.55%	0.07%	0.70%	0.00%	0.85%	0.07%
过去一年	1.85%	0.14%	1.42%	0.00%	0.43%	0.14%
过去三年	23.07%	0.16%	6.49%	0.01%	16.58%	0.15%
自基金合同生效起至今	23.31%	0.16%	6.77%	0.01%	16.54%	0.15%

圆信永丰纯债 C 类

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	1.26%	0.06%	0.12%	0.00%	1.14%	0.06%
过去三个月	1.26%	0.06%	0.35%	0.00%	0.91%	0.06%
过去六个月	1.46%	0.07%	0.70%	0.00%	0.76%	0.07%
过去一年	1.66%	0.14%	1.42%	0.00%	0.24%	0.14%
过去三年	21.52%	0.16%	6.49%	0.01%	15.03%	0.15%
自基金合同生效起至今	21.77%	0.16%	6.77%	0.01%	15.00%	0.15%

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")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		
许燕	本基金基金经理	2016 年 1 月 22 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基金投资部下设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	2016 年 10 月 21 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。

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,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。

4.3.2 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

上半年经济平稳运行,且表现出较强的韧性,CPI 低位徘徊,工业生产 PPI 见顶回落。上半年债券市场呈现震荡格局,受金融去杠杆政策影响,债券收益率在 5 月前上行速度较快,信用利差大幅走阔;6 月伴随前期金融监管取得一定进展,央行于半年末 MPA 考核期积极对冲流动性季节波动,通过公开市场逆回购、MLF 等大量净投放银行间流动性,带动债券市场交投情绪回暖。国债/金融债利率自六月上旬最高点快速下行至 10-25BP,信用债也下浮 20-70BP 显示信用走势更强,带动债券基金产品净值出现一波明显上涨。

投资策略上,上半年债券基金整体维持短久期、低杠杆的保守稳健操作策略。六月以来伴随市场回暖,考虑债券票息的持有价值好于交易价值,我们逐步拉长债券组合久期,从一季度偏防御的投资策略调整到防攻互补的中性久期组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,圆信永丰纯债 A 类的基金份额净值为 1.048 元(累计净值:1.228 元),本报告期基金份额净值增长率为 1.55%;截至本报告期末,圆信永丰纯债 C 类的基金份额净值为 1.044 元(累计净值:1.214 元),本报告期基金份额净值增长率为 1.46%;圆信永丰纯债 A、C 类的同期业绩比较基准收益率均为 0.70%。

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。在目前过度平坦的曲线在陡峭化过程中,中短端投资机会更为确定,包括 1-3 年利率债和中高等级信用债等。信用交易价值虽不高,但票息部分收益仍可在与负债久期匹配后稳定获取。

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。

报告期内,本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债数据估值服务;本基金与中证指数有限公司根据《中证债券估值数据服务协议》而取得中证数据估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关规定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益分配每年至多分配 6 次,每类基金份额的每份基金份额每次分配比例不低于收益分配基准日该类别每份基金份额可供分配利润的 20%。

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纯债债券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,圆信永丰纯债债券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纯债债券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,圆信永丰纯债债券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纯债债券型证券投资基金 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:圆信永丰纯债债券型证券投资基金
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		3,268,333.28	710,723.70
结算备付金		713,868.10	1,847,544.60
存出保证金		8,738.61	5,486.87
交易性金融资产		112,665,378.60	258,928,448.30
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		112,665,378.60	258,928,448.30
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		3,000,000.00	-
应收证券清算款		-	5,000,000.00
应收利息		2,864,228.33	5,010,174.86
应收股利		-	-
应收申购款		10,100.00	20,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		122,530,646.92	271,522,378.33
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		14,916,000.00	15,854,000.00
应付证券清算款		587.65	4,757,053.08
应付赎回款		2,016.03	508,245.79
应付管理人报酬		61,444.28	160,964.86
应付托管费		17,555.51	45,989.96
应付销售服务费		738.28	2,484.67
应付交易费用		1,001.85	2,200.00
应交税费		-	-
应付利息		26,769.42	1,983.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		119,505.56	120,381.57
负债合计		15,145,618.58	21,453,303.32
所有者权益:			
实收基金		102,463,981.29	242,255,866.31
未分配利润		4,921,047.05	7,813,208.70
所有者权益合计		107,385,028.34	250,069,075.01
负债和所有者权益总计		122,530,646.92	271,522,378.33

注:报告截止日 2017 年 6 月 30 日,圆信永丰纯债 A 类的基金份额净值 1.048 元,基金份额总额 100,473,910.67 份;圆信永丰纯债 C 类的基金份额净值 1.044 元,基金份额总额 1,990,070.62 份。圆信永丰纯债份额总额合计为 102,463,981.29 份。

6.2 利润表

会计主体:圆信永丰纯债债券型证券投资基金
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		3,205,180.91	3,955,691.71
1.利息收入		3,231,460.80	4,423,337.63
其中:存款利息收入		16,538.81	73,452.94
债券利息收入		3,126,135.87	4,282,105.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		88,786.12	67,778.87
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-2,263,030.47	582,812.04
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-2,263,030.47	582,812.04
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)		2,234,896.34	-1,355,208.54
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,854.24	304,750.58
减:二、费用		981,212.95	1,202,828.16
1. 管理人报酬		437,307.43	620,815.68
2. 托管费		124,945.04	177,375.92
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	9,511.20	42,587.13
4. 交易费用		4,572.06	4,783.81
5. 利息支出		319,547.82	274,870.30
其中:卖出回购金融资产支出		319,547.82	274,870.30
6. 其他费用		85,329.40	82,395.32
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		2,223,967.96	2,752,863.55
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		2,223,967.96	2,752,863.55

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:圆信永丰纯债债券型证券投资基金
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)	242,255,866.31	7,813,208.70	250,069,075.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	2,223,967.96	2,223,967.96
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)	-139,791,885.02	-5,116,129.61	-144,908,014.63
其中:1.基金申购款	3,372,320.89	119,207.06	3,491,527.95
2.基金赎回款	-143,164,205.91	-5,235,336.67	-148,399,542.58
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)	102,463,981.29	4,921,047.05	107,385,028.34
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)	147,124,034.87	28,312,114.32	175,436,149.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	2,752,863.55	2,752,863.55
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)	-8,724,523.39	100,819,133.76	92,094,610.37
其中:1.基金申购款	601,349,765.65	114,516,497.53	715,866,263.18
2.基金赎回款	-610,074,289.04	-13,697,363.77	-623,771,652.81
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)	-	-127,879,364.45	-127,879,364.45
五、期末所有者权益(基金净值)	138,399,511.48	4,004,747.18	142,404,258.66

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

圆信永丰纯债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[2014] 415 号《关于核准圆信永丰纯债债券型证券投资基金募集的批复》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《圆信永丰纯债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 206,810,910.33 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 290 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《圆信永丰纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 5 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 206,815,260.97 份基金份额,其中认购资金利息折合 4,350.64 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《圆信永丰纯债债券型证券投资基金基金合同》和《圆信永丰纯债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《圆信永丰纯债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、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》、《圆信永丰纯债债券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

本基金本报告期内未发生会计估计变更。

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

-

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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

-

6.4.7.1.2 债券交易

-

6.4.7.1.3 债券回购交易

-

6.4.7.1.4 权证交易

-

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

-

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	437,307.43	620,815.68
其中:支付销售机构的客户维护费	12,348.87	9,085.25

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 0.7%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 × 0.7% / 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	124,945.04	177,375.92

注:支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2%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 × 0.2% / 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		
	圆信永丰纯债 A 类	圆信永丰纯债 C 类	合计
圆信永丰基金公司	-	32.60	32.60
中国工商银行	-	3,721.37	3,721.37
合计	-	3,753.97	3,753.97
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		
	圆信永丰纯债 A 类	圆信永丰纯债 C 类	合计
圆信永丰基金公司	-	35,902.03	35,902.03
中国工商银行	-	3,707.32	3,707.32
合计	-	39,609.35	39,609.35

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 0.4%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=C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.4% /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份额单位:份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	圆信永丰纯债 A 类	圆信永丰纯债 C 类
基金合同生效日(2014 年 5 月 30 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	4,835,396.52	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	4,835,396.52	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.8100%	-

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。

6.4.7.4.2 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	3,268,333.28	8,432.31	11,497,825.71	51,632.39

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:报告期内本基金未参与关联方承销证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

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而流通受限的股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金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。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 06 月 30 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 14,916,000.00 元,于 2017 年 7 月 3 日、2017 年 7 月 4 日、2017 年 7 月 5 日、2017 年 7 月 7 日、2017 年 7 月 10 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 112,665,378.60 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

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 2017 年 6 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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	112,665,378.60	91.95
	其中:债券	112,665,378.60	91.95
	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	3,000,000.00	2.45
	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	3,982,201.38	3.25
7	其他各项资产	2,883,066.94	2.35
8	合计	122,530,646.92	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

-

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

-

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

-

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

-

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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,969,100.00	4.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	69,024,573.60	64.28
5	企业短期融资券	9,011,700.00	8.39
6	中期票据	20,729,500.00	19.30
7	可转债(可交换债)	31,305.00	0.03
8	同业存单	8,899,200.00	8.29
9	其他	-	-
10	合计	112,665,378.60	104.92

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	101364008	13 兵团建工 MTN001	100,000	10,321,000.00	9.61
2	112472	16 裕同 01	106,000	10,315,920.00	9.61
3	1380105	13 龙岩工发债	100,000	10,127,000.00	9.43
4	1280387	12 西子债	100,000	10,070,000.00	9.38
5	122408	15 美都债	100,000	10,005,000.00	9.32

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

-

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

-

7.10.3 本期国债期货投资评价

-

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.12.2

-

7.11.3 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	8,738.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,864,228.33
5	应收申购款	10,100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,883,066.94

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132002	15 天集 EB	31,305.00	0.03

7.11.5 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不存在流通受限情况。

7.11.6 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
圆信永丰纯债 A 类	125	803,791.29	98,118,888.98	97.66%	2,355,021.69	2.34%
圆信永丰纯债 C 类	166	11,988.38	-	-	1,990,070.62	100.00%
合计	291	352,109.90	98,118,888.98	95.76%	4,345,092.31	4.24%

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	圆信永丰纯债 A 类	-	-
	圆信永丰纯债 C 类	13,994.13	0.7032%
	合计	13,994.13	0.0137%

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)。

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	圆信永丰纯债 A 类	0
	圆信永丰纯债 C 类	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	圆信永丰纯债 A 类	0
	圆信永丰纯债 C 类	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	圆信永丰纯债 A 类	圆信永丰纯债 C 类
基金合同生效日(2014 年 5 月 30 日)基金份额总额	202,506,138.57	4,309,122.40
本报告期期初基金份额总额	236,455,265.27	5,800,601.04
本报告期基金总申购份额	487,844.21	2,884,476.68
减:本报告期基金总赎回份额	136,469,198.81	6,695,007.10
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	100,473,910.67	1,990,070.62

§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。

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及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	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	164,938,400.63	100.00%	903,206,000.00	100.00%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

注:1. 本报告期内基金新增 2 个证券公司交易单元,分别为国金证券股份有限公司上交所及深交所交易单元。

2. 本基金管理人负责选择证券经营机构,租用其交易单元作为本基金的交易单元。选择租用证券公司基金交易单元的选择标准如下:

(1)资金实力雄厚,财务状况良好;

(2)经营行为稳健文件规范,在业内有良好的声誉;

(3)内控制度健全,内部管理严格;并能满足基金运作高度保密的要求;

(4)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行交易的需要;并能为基金提供全面的信息服务;

(5)研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员;

(6)具备较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较强的研究综合实力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、策略、行业、个股分析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。

§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 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	93,283,395.52	-	-	93,283,395.52	91.04
	2	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 18 日	125,003,000.00	-	125,003,000.00	0.00	0.00
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。							

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