

# 圆信永丰兴利债券型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017-06-30

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

报告送出日期：2017-08-29

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

[重要提示](#)

[基金简介](#)

[基金基本情况](#)

[基金产品说明](#)

[基金管理人和基金托管人](#)

[信息披露方式](#)

[其他相关资料](#)

[主要财务指标和基金净值表现](#)

[主要会计数据和财务指标](#)

[基金净值表现](#)

[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](#)

[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](#)

[管理人报告](#)

[基金管理人及基金经理情况](#)

[基金管理人及其管理基金的经验](#)

[基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介](#)

[管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明](#)

[管理人对报告期内公平交易情况的专项说明](#)

[公平交易制度的执行情况](#)

[异常交易行为的专项说明](#)

[管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明](#)

[报告期内基金投资策略和运作分析](#)

[报告期内基金的业绩表现](#)

[管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望](#)

[管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明](#)

[管理人对报告期内基金利润分配情况的说明](#)

[管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明](#)

[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](#)

[托管人报告](#)

[报告期内本基金托管人遵规守信情况声明](#)

[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](#)

[托管人对半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见](#)

[半年度财务会计报告（未经审计）](#)

[资产负债表](#)

利润表  
所有者权益（基金净值）变动表  
报表附注  
基金基本情况  
会计报表的编制基础  
遵循企业会计准则及其他有关规定的声明  
重要会计政策和会计估计  
会计年度  
记账本位币  
金融资产和金融负债的分类  
金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认  
金融资产和金融负债的估值原则  
金融资产和金融负债的抵销  
实收基金  
损益平准金  
收入/(损失)的确认和计量  
费用的确认和计量  
基金的收益分配政策  
分部报告  
其他重要的会计政策和会计估计  
会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明  
会计政策变更的说明  
会计估计变更的说明  
差错更正的说明  
税项  
重要财务报表项目的说明  
银行存款  
衍生金融资产/负债  
买入返售金融资产  
各项买入返售金融资产期末余额  
期末买断式逆回购交易中取得的债券  
应收利息  
其他资产  
应付交易费用  
其他负债  
实收基金  
未分配利润  
存款利息收入  
股票投资收益  
股票投资收益——买卖股票差价收入  
债券投资收益  
债券投资收益项目构成  
债券投资收益——买卖债券差价收入  
债券投资收益——赎回差价收入

债券投资收益——申购差价收入  
资产支持证券投资收益  
衍生工具收益  
衍生工具收益——买卖权证差价收入  
衍生工具收益——其他投资收益  
股利收益  
公允价值变动收益  
其他收入  
交易费用  
其他费用  
或有事项、资产负债表日后事项的说明  
或有事项  
资产负债表日后事项  
关联方关系  
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  
本报告期与基金发生关联交易的各关联方  
本报告期及上年度可比期间的关联方交易  
通过关联方交易单元进行的交易  
股票交易  
权证交易  
应支付关联方的佣金  
关联方报酬  
基金管理费  
基金托管费  
销售服务费  
与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
各关联方投资本基金的情况  
报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
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  
由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入  
本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况  
其他关联交易事项的说明  
利润分配情况  
利润分配情况——非货币市场基金  
期末本基金持有的流通受限证券  
因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券  
期末持有的暂时停牌等流通受限股票  
期末债券正回购交易中作为抵押的债券  
银行间市场债券正回购  
交易所市场债券正回购  
金融工具风险及管理  
风险管理政策和组织架构  
信用风险  
按短期信用评级列示的债券投资

按长期信用评级列示的债券投资  
流动性风险  
金融资产和金融负债的到期期限分析  
市场风险  
利率风险  
利率风险敞口  
利率风险的敏感性分析  
外汇风险  
外汇风险敞口  
外汇风险的敏感性分析  
其他价格风险  
其他价格风险敞口  
其他价格风险的敏感性分析  
采用风险价值法管理风险  
有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项  
投资组合报告  
期末基金资产组合情况  
报告期末按行业分类的股票投资组合  
报告期末按行业分类的股票投资组合  
报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细  
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  
报告期内股票投资组合的重大变动  
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  
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  
买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额  
期末按债券品种分类的债券投资组合  
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细  
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细  
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  
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细  
报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金投资股指期货的投资政策  
报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
本期国债期货投资政策  
报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本期国债期货投资评价  
投资组合报告附注  
本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明  
基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明  
期末其他各项资产构成  
期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

投资组合报告附注的其他文字描述部分

基金份额持有人信息

期末基金份额持有人户数及持有人结构

期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

发起式基金发起资金持有份额情况

开放式基金份额变动

重大事件揭示

基金份额持有人大会决议

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

涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金投资策略的改变

为基金进行审计的会计师事务所情况

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

其他重大事件

重大事件揭示

基金份额持有人大会决议

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

涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金投资策略的改变

为基金进行审计的会计师事务所情况

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

其他重大事件

影响投资者决策的其他重要信息

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

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

备查文件目录

存放地点

查阅方式

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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

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

场内简称

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

**2016-02-23**

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

**1,798,739,508.78**

基金合同存续期

不定期

下属 2 级基金的基金简称

圆信永丰兴利 A

圆信永丰兴利 C

下属 2 级基金的场内简称

下属 2 级基金的交易代码

**001918**

**001919**

报告期末下属 2 级基金的份额总额

**1,798,391,308.88**

**348,199.90**

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。

下属分级基金的风险收益特征

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

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

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](http://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

其他相关资料

项目

名称

办公地址

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

主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期

报告期(2017-01-01 至 2017-06-30)

圆信永丰兴利

圆信永丰兴利 A

圆信永丰兴利 C

本期已实现收益

28,297,692.27

7,338.54

本期利润

9,148,328.62

-703.84

加权平均基金份额本期利润

0.0051

-0.0013

本期加权平均净值利润率

-%

0.51 %

-0.13 %

本期基金份额净值增长率

-%

0.50 %

0.30 %

报告期末

报告期末(2017-06-30)

圆信永丰兴利

圆信永丰兴利 A

圆信永丰兴利 C

期末可供分配利润

4,298,414.71

68.37

期末可供分配基金份额利润



0.0024  
0.0002  
期末基金资产净值  
1,802,689,723.59  
348,268.27  
期末基金份额净值  
1.002  
1.000  
报告期末  
报告期末(2017-06-30)  
圆信永丰兴利  
圆信永丰兴利 A  
圆信永丰兴利 C  
基金份额累计净值增长率  
-%  
1.70 %  
1.30 %  
基金净值表现  
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 A  
阶段  
净值增长率①  
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  
1.62 %  
0.06 %  
0.90 %  
0.06 %  
0.72 %  
0.00 %  
过去三个月  
0.50 %  
0.09 %  
-0.88 %  
0.08 %  
1.38 %  
0.01 %  
过去六个月  
0.50 %  
0.09 %  
-2.11 %

0.08 %

2.61 %

0.01 %

过去一年

0.20 %

0.11 %

-3.50 %

0.10 %

3.70 %

0.01 %

自基金合同生效起至今

1.70 %

0.11 %

-3.81 %

0.09 %

5.51 %

0.02 %

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 C  
阶段

净值增长率①

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

1.63 %

0.06 %

0.90 %

0.06 %

0.73 %

0.00 %

过去三个月

0.40 %

0.09 %

-0.88 %

0.08 %

1.28 %

0.01 %

过去六个月

0.30 %

0.09 %

-2.11 %

0.08 %

2.41 %  
0.01 %  
过去一年  
-0.20 %  
0.11 %  
-3.50 %  
0.10 %  
3.30 %  
0.01 %  
自基金合同生效起至今  
1.30 %  
0.11 %  
-3.81 %  
0.09 %  
5.11 %  
0.02 %

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

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 C

#### 基金管理人及基金经理情况

##### 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。

##### 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

2016-02-23

-

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

2016-04-11

-

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。

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。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

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。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

## 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。

## 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，圆信永丰兴利 A 类的基金份额净值为 1.002 元（累计净值：1.017 元），本报告期基金份额净值增长率为 0.50%；截至本报告期末，圆信永丰兴利 C 类的基金份额净值为 1.000 元（累计净值：1.013 元），本报告期基金份额净值增长率为 0.30%；圆信永丰兴利 A、C 类的同期业绩比较基准收益率均为-2.11%。

## 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。

## 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。

## 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，基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金报告期内实施利润分配 1 次，实际分配金额为 27,291,155.20 元。

## 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-  
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。

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。

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。

托管人对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。

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：2017-06-30

单位：人民币元

资产

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

资产：

银行存款

202,053,682.61

5,668,130.02

结算备付金

500.08

529,673.59

存出保证金

16.54

2,257.15

交易性金融资产

1,530,599,337.40

1,777,422,480.60

其中：股票投资

-

-

基金投资

-
-
债券投资
1,530,599,337.40
1,777,422,480.60
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
50,000,195.00
8,000,000.00
应收证券清算款
-
-
应收利息
21,322,320.63
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
-
-
资产总计
1,803,976,052.26
1,845,452,401.03
负债和所有者权益
本期末
2017-06-30
上年度末
2016-12-31
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

-

-

应付赎回款

201.38

519,097.44

应付管理人报酬

586,859.84

627,655.49

应付托管费

220,072.42

235,370.78

应付销售服务费

113.72

274.61

应付交易费用

1,307.48

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

129,505.56



130,000.00

负债合计

938,060.40

1,515,550.56

所有者权益：

-

-

实收基金

1,798,739,508.78

1,821,593,774.19

未分配利润

4,298,483.08

22,343,076.28

所有者权益合计

1,803,037,991.86

1,843,936,850.47

负债和所有者权益总计

1,803,976,052.26

1,845,452,401.03

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，圆信永丰兴利 A 基金份额净值 1.002 元，基金份额总额 1,798,391,308.88 份；圆信永丰兴利 C 基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 348,199.90 份。圆信永丰兴利份额总额合计为 1,798,739,508.78 份。

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：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

一、收入

14,142,307.97

20,076,477.67

1.利息收入

43,692,512.39

20,539,932.94

其中：存款利息收入

3,318,326.51

181,917.92

债券利息收入

40,091,154.68

19,284,384.12

资产支持证券利息收入

-  
-  
    买入返售金融资产收入  
283,031.20  
1,073,630.90  
    其他利息收入  
-  
-  
2.投资收益（损失以“-”填列）  
-10,393,007.12  
2,328,632.70  
其中：股票投资收益  
-  
-  
    基金投资收益  
-  
-  
    债券投资收益  
-10,393,007.12  
2,328,632.70  
    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）  
-19,157,406.03  
-2,795,224.02  
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）  
-  
-  
5.其他收入（损失以“-”号填列）  
208.73  
3,136.05  
减：二、费用  
4,994,683.19  
2,865,413.67

1. 管理人报酬	
3,570,356.77	
1,962,269.47	
2. 托管费	
1,338,883.76	
735,851.00	
3. 销售服务费	
1,121.17	
1,818.23	
4. 交易费用	
1,626.27	
8,338.24	
5. 利息支出	
15.89	
94,289.16	
其中：卖出回购金融资产支出	
15.89	
94,289.16	
6. 其他费用	
82,679.33	
62,847.57	
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	
9,147,624.78	
17,211,064.00	
减：所得税费用	
-	
-	
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	
9,147,624.78	
17,211,064.00	
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：2017-01-01 至 2017-06-30	
单位：人民币元	
项目	
本期	
2017-01-01 至 2017-06-30	
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）	
1,839,331,036.49	
22,343,076.28	
1,843,936,850.47	

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

9,147,624.78

9,147,624.78

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）

-22,854,265.41

98,937.22

-22,755,328.19

其中：1.基金申购款

94,609.64

-101.22

94,508.42

2.基金赎回款

-22,948,875.05

99,038.44

-22,849,836.61

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）

-

-27,291,155.20

-27,291,155.20

五、期末所有者权益（基金净值）

1,798,739,508.78

4,298,483.08

1,803,037,991.86

项目

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

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）

-

-

-

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

17,211,064.00

17,211,064.00

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）

1,839,331,036.49

11,117,642.12

1,850,448,678.61

其中：1.基金申购款

1,842,650,881.85

11,129,583.80

1,853,780,465.65

2.基金赎回款

-3,319,845.36

-11,941.68

-3,331,787.04

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）

1,839,331,036.49

22,343,076.28

1,843,936,850.47

本报告第 6.1 页至第 6.4 页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：董晓亮

主管会计工作负责人：于娟

会计机构负责人：

虞俏依

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注

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》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。

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。

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 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。

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。

重要会计政策和会计估计

-

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止。

记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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。

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。

#### 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。

#### 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。

#### 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。

#### 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)。

#### 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。

#### 费用的确认和计量

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。

#### 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。

#### 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。

#### 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和同业存单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。

#### 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 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。

##### 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。

##### 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。

#### 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。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

活期存款

7,053,682.61

-

定期存款

195,000,000.00

-

其中：存款期限 1-3 个月

-

-

存款期限 1 个月以内

0.00

-

存款期限 1-3 个月

195,000,000.00

-

存款期限 3 个月以上

0.00

-

其他存款

-

-

合计

202,053,682.61

5,668,130.02

交易性金融资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

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

1,913,896.40

1,901,636.70

-12,259.70

银行间市场

1,588,181,966.49

1,528,697,700.70

-59,484,265.79

合计

1,590,095,862.89

1,530,599,337.40

-59,496,525.49

资产支持证券

-

-

-

基金

-

-

-

其他

-

-

-

合计

1,590,095,862.89

1,530,599,337.40

-59,496,525.49

项目

上年度末

2016-12-31

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

-

-

-

银行间市场

-

-

-

合计

-

-

-

资产支持证券

-

-

-

基金

-

-

-

其他

-

-

-

合计

-

-

-

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

项目

上年度末

2016-12-31

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

注：报告期末本基金未持有衍生金融工具。

买入返售金融资产

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

**2017-06-30**

账面余额

其中：买断式逆回购

银行间买入返售证券

**50,000,195.00**

-

交易所买入返售证券

-

-

合计

**50,000,195.00**

-

项目

上年度末

**2016-12-31**

账面余额

其中：买断式逆回购

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目

本期末

**2017-06-30**

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

项目

上年度末

**2016-12-31**

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

注：报告期末本基金未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

应收利息

单位：人民币元

项目

本期末

**2017-06-30**

上年度末

**2016-12-31**

应收活期存款利息

**3,745.83**

-

应收定期存款利息

**1,025,541.45**

-

应收其他存款利息

-

-

应收结算备付金利息

**0.18**

-

应收债券利息

20,091,724.77

-

应收买入返售证券利息

201,308.40

-

应收申购款利息

-

-

应收黄金合约拆借孳息

-

-

其他

-

-

合计

21,322,320.63

53,819,859.67

其他资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

其他应收款

-

-

待摊费用

-

-

合计

-

-

注：报告期末本基金未持有其他资产。

应付交易费用

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

交易所市场应付交易费用

-

-  
银行间市场应付交易费用  
1,307.48

-  
合计  
1,307.48

3,152.24  
其他负债  
单位：人民币元

项目  
本期末  
2017-06-30

上年度末  
2016-12-31  
应付券商交易单元保证金

-  
-  
应付赎回费

-  
-  
预提信息披露费  
99,752.78

-  
预提审计费  
29,752.78

-  
合计  
129,505.56

130,000.00  
实收基金  
单位：人民币元

项目  
本期  
2017-01-01 至 2017-06-30

圆信永丰兴利 A  
圆信永丰兴利 C  
基金份额（份）  
账面金额  
基金份额（份）  
账面金额

上年度末  
1,820,812,007.20  
1,820,812,007.20  
781,766.99



781,766.99  
本期申购  
58,032.85  
58,032.85  
36,576.79  
36,576.79  
本期赎回（以“-”号填列）  
-22,478,731.17  
-22,478,731.17  
-470,143.88  
-470,143.88  
本期末  
1,798,391,308.88  
1,798,391,308.88  
348,199.90  
348,199.90  
未分配利润  
圆信永丰兴利 A  
单位：人民币元  
项目  
已实现部分  
未实现部分  
未分配利润合计  
上年度末  
57,537,361.74  
-35,202,107.39  
22,335,254.35  
本期利润  
28,297,692.27  
-19,149,363.65  
9,148,328.62  
本期基金份额交易产生的变动数  
-530,550.89  
626,266.06  
95,715.17  
其中：基金申购款  
1,348.12  
-1,590.44  
-242.32  
基金赎回款  
-531,899.01  
627,856.50  
95,957.49  
本期已分配利润

-27,280,883.43

-

-27,280,883.43

本期末

58,023,619.69

-53,725,204.98

4,298,414.71

圆信永丰兴利 C

单位：人民币元

项目

已实现部分

未实现部分

未分配利润合计

上年度末

22,888.16

-15,066.23

7,821.93

本期利润

7,338.54

-8,042.38

-703.84

本期基金份额交易产生的变动数

-9,514.09

12,736.14

3,222.05

其中：基金申购款

962.28

-821.18

141.10

基金赎回款

-10,476.37

13,557.32

3,080.95

本期已分配利润

-10,271.77

-

-10,271.77

本期末

10,440.84

-10,372.47

68.37

存款利息收入

单位：人民币元

项目

本期	
2017-01-01 至 2017-06-30	
上年度可比期间	
2016-02-23 至 2016-06-30	
活期存款利息收入	
103,573.91	
-	
定期存款利息收入	
3,212,680.33	
-	
其他存款利息收入	
-	
-	
结算备付金利息收入	
2,064.65	
-	
其他	
7.62	
-	
合计	
3,318,326.51	
181,917.92	
股票投资收益	
股票投资收益——买卖股票差价收入	
单位：人民币元	
项目	
本期	
2017-01-01 至 2017-06-30	
上年度可比期间	
2016-02-23 至 2016-06-30	
卖出股票成交总额	
-	
-	
减：卖出股票成本总额	
-	
-	
买卖股票差价收入	
-	
-	
债券投资收益	
债券投资收益项目构成	
单位：人民币元	
项目	
本期	

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入

-10,393,007.12

-

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

-10,393,007.12

2,328,632.70

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额

328,988,307.47

-

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额

318,750,549.17

-

减：应收利息总额

20,630,765.42

-

买卖债券差价收入

-10,393,007.12

-

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

赎回基金份额对价总额

-

-

减：现金支付赎回款总额

-

-

减：赎回债券成本总额

-

-

减：赎回债券应收利息总额

-

-

赎回差价收入

-

-

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

申购基金份额对价总额

-

-

减：现金支付申购款总额

-

-

减：申购债券成本总额

-

-

减：申购债券应收利息总额

-

-

申购差价收入

-

-

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

卖出资产支持证券成交总额

-

-

减：卖出资产支持证券成本总额

-

-

减：应收利息总额

-

-

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。

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

卖出权证成交总额

-

-

减：卖出权证成本总额

-

-

买卖权证差价收入

-

-

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

衍生工具收益——其他投资收益

项目

本期收益金额

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间收益金额

2016-02-23 至 2016-06-30

权证投资收益

-

-

股指期货-投资收益

-

-

股利收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

股票投资产生的股利收益

-

-

基金投资产生的股利收益

-

-

合计

-

-

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

1.交易性金融资产

-19,157,406.03

-

——股票投资

-

-

——债券投资

-19,157,406.03

-

——资产支持证券投资

-

-

——基金投资

-

-

——贵金属投资

-

-

——其他

-

-

2.衍生工具

-

-

——权证投资

-

-

3.其他

-

-

合计

-19,157,406.03

-2,795,224.02

其他收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

基金赎回费收入

208.73

-

合计

208.73

3,136.05

交易费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

交易所市场交易费用

1.27

-

银行间市场交易费用

1,625.00

-

合计

1,626.27

8,338.24

其他费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30



审计费用

29,752.78

-

信息披露费

29,752.78

-

其他

-

-

银行划款手续费用

4,573.77

-

账户服务费用

18,600.00

-

合计

82,679.33

62,847.57

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

截至资产负债表报出日，本基金并无须作披露的或有事项。

资产负债表日后事项

截止财务报表报出日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

关联方关系

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

-

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

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

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。

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。

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23(基金合同生效日)至 2016-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

权证交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23(基金合同生效日)至 2016-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

关联方名称

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

当期发生的基金应支付的管理费

3,570,356.77

1,962,269.47

其中：支付销售机构的客户维护费

1,785,119.08

1,471,365.35

注：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 0.4%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 × 0.4% / 当年天数。

基金托管费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

当期发生的基金应支付的托管费

1,338,883.76

735,851.00

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。

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

2017-01-01 至 2017-06-30

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

-

16.48

16.48

兴业银行

-

915.24

915.24

合计

-

931.72

931.72

获得销售服务费的各关联方名称

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

当期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

-

70.49

70.49

兴业银行

-

1,253.94

1,253.94

合计

-

1,324.43

1,324.43

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。

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

银行间市场交易的各关联方名称

债券交易金额

基金逆回购

基金正回购

基金买入

基金卖出

交易金额

利息收入

交易金额

利息支出

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

银行间市场交易的各关联方名称

债券交易金额

基金逆回购

基金正回购

基金买入

基金卖出

交易金额

利息收入

交易金额

利息支出

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。

各关联方投资本基金的情况

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

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

份额级别

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

基金合同生效日（2016-02-23）持有的基金份额

-

-

-

-

期初持有的基金份额

-

-

-

-

期间申购/买入总份额

-

-

-

-

期间因拆分增加的份额

-

-

-

-

减：期间赎回/卖出总份额

-

-

-

-

期末持有的基金份额

-

-

-

-

期末持有的基金份额占基金总份额比例

-%

-%

-%

-%

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。

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

项目

圆信永丰兴利 A

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

持有的基金份额

持有的基金份额占基金总份额的比例

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

99.47 %

1,788,895,861.97

98.25 %

项目

圆信永丰兴利 C

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

持有的基金份额

持有的基金份额占基金总份额的比例

持有的基金份额

持有的基金份额占基金总份额的比例

注：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。

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

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

期末余额

当期利息收入

期末余额

当期利息收入

兴业银行

7,053,682.61

103,573.91

3,257,044.31

171,974.23

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。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

上年度可比期间

2016-02-23 至 2016-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

注：报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

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。

利润分配情况

利润分配情况——非货币市场基金圆信永丰兴利 A

单位：人民币元

序号

权益登记日

除息日

每 10 份基金份额分红数

现金形式发放总额

再投资形式发放总额

本期利润分配合计

备注

1

2017-01-18

2017-01-18

0.1500

27,259,464.83

21,418.60

27,280,883.43

-

合计

-

-

0.1500

27,259,464.83

21,418.60

27,280,883.43

-

利润分配情况——非货币市场基金圆信永丰兴利 C

单位：人民币元

序号

权益登记日

除息日

每 10 份基金份额分红数

现金形式发放总额

再投资形式发放总额

本期利润分配合计

备注

1

2017-01-18

2017-01-18

0.1300

8,506.20

1,765.57

10,271.77

-

合计

-

-

0.1300

8,506.20

1,765.57

10,271.77

-

期末（2017-06-30）本基金持有的流通受限证券



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

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

受限证券类别：债券

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

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。

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码

股票名称

停牌日期

停牌原因

期末估值单价

复牌日期

复牌开盘单价

数量（股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

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。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

-

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

注：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。

交易所市场债券正回购

本报告期末本基金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。

金融工具风险及管理

-

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、风险控制和风险监督；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。

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，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。

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

A-1

-

-

A-1 以下

-

-

未评级

79,691,000.00

66,811,635.40

合计

79,691,000.00

66,811,635.40

注：未评级部分为国债、政策性金融债

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

AAA

136,011,200.00

138,875,200.00

AAA 以下

881,744,500.70

1,113,233,976.60

未评级

433,152,636.70

458,501,668.60

合计

1,450,908,337.40

1,710,610,845.20

注：未评级部分为国债、政策性金融债

## 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、组合在短期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公司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。

本期末，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

## 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末

**2017-06-30**

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

-

上年度末

**2016-12-31**

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

-

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。

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。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

1个月以内

1-3个月

6个月以内

3个月-1年

6个月-1年

1年以内

1-5年

5年以上

不计息

合计

资产

银行存款

47,053,682.61

155,000,000.00

-

-

-

-

-

-

-

-

202,053,682.61

结算备付金

500.08

-

-

-

-

-

-

-

-

-

500.08

存出保证金

16.54

-

-

-

-

-

-

-

-

16.54

交易性金融资产

-

9,907,807.40

-

110,619,330.00

-

-

517,775,200.00

892,297,000.00

-

1,530,599,337.40

买入返售金融资产

-

50,000,195.00

-

-

-

-

-

-

-

50,000,195.00

应收利息

-

-

-

-

-

-

-  
-  
21,322,320.63  
21,322,320.63  
其他资产  
-  
-  
-  
-  
-  
-  
-  
-  
-  
-  
-  
-  
资产总计  
47,054,199.23  
214,908,002.40  
0.00  
110,619,330.00  
0.00  
0.00  
517,775,200.00  
892,297,000.00  
21,322,320.63  
1,803,976,052.26  
负债  
应付赎回款  
-  
-  
-  
-  
-  
-  
-  
-  
-  
201.38  
201.38  
应付管理人报酬  
-  
-  
-  
-  
-

-

-

-

586,859.84

586,859.84

应付托管费

-

-

-

-

-

-

-

-

220,072.42

220,072.42

应付销售服务费

-

-

-

-

-

-

-

-

113.72

113.72

应付交易费用

-

-

-

-

-

-

-

-

1,307.48

1,307.48

其他负债

-

-

-

-

-



-  
-  
-  
129,505.56  
129,505.56  
负债总计  
0.00  
0.00  
0.00  
0.00  
0.00  
0.00  
0.00  
0.00  
0.00  
938,060.40  
938,060.40  
利率敏感度缺口  
47,054,199.23  
214,908,002.40  
0.00  
110,619,330.00  
0.00  
0.00  
517,775,200.00  
892,297,000.00  
20,384,260.23  
1,803,037,991.86  
上年度末  
2016-12-31  
1 个月以内  
1-3 个月  
6 个月以内  
3 个月-1 年  
6 个月-1 年  
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  
51,985,000.00  
198,262,000.00  
-  
85,141,280.60  
-  
-  
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  
66,185,060.76  
198,262,000.00  
-  
85,141,280.60  
-  
-  
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  
66,185,060.76  
198,262,000.00  
-  
85,141,280.60  
-  
-  
531,472,200.00  
910,562,000.00  
52,314,309.11  
1,843,936,850.47  
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：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-06-30

1.市场利率下降 25 个基点

12,250,000.00

14,380,000.00

2.市场利率上升 25 个基点

-12,060,000.00

-14,190,000.00

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。

外汇风险敞口

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

项目

上期末

2016-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

外汇风险的敏感性分析

假设

-

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：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-06-30

公允价值

占基金资产净值比例 (%)	
公允价值	
占基金资产净值比例 (%)	
交易性金融资产—股票投资	-
-	-
-	-
-	-
交易性金融资产—基金投资	-
-	-
-	-
-	-
交易性金融资产—债券投资	1,530,599,337.40
	84.89
	1,777,422,480.60
	96.39
交易性金融资产—贵金属投资	-
-	-
-	-
-	-
衍生金融资产—权证投资	-
-	-
-	-
-	-
其他	-
-	-
-	-
-	-
合计	1,530,599,337.40
	84.89
	1,777,422,480.60
	96.39
其他价格风险的敏感性分析	
假设	-
-	-
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: 人民币元)	



本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

采用风险价值法管理风险

-

假设

-

-

分析

风险价值（金额单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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 1,530,599,337.40 元，无属于第一层级及第三层次的余额。

(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 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 and 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。

期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号

项目

金额（元）

占基金总资产的比例（%）

1

权益类投资

-

-

其中：股票

-

-

2

固定收益投资

1,530,599,337.40

84.85

其中：债券

1,530,599,337.40

84.85

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

50,000,195.00

2.77

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

202,054,182.69

11.20

7

其他各项资产

21,322,337.17

1.18

8

合计

1,803,976,052.26

100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合

代码

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

A

农、林、牧、渔业

-

-

B

采矿业

-

-

C

制造业

-

-

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

-

E

建筑业

-

-

F

批发和零售业

-  
-

**G**

交通运输、仓储和邮政业

-  
-

**H**

住宿和餐饮业

-  
-

**I**

信息传输、软件和信息技术服务业

-  
-

**J**

金融业

-  
-

**K**

房地产业

-  
-

**L**

租赁和商务服务业

-  
-

**M**

科学研究和技术服务业

-  
-

**N**

水利、环境和公共设施管理业

-  
-

**O**

居民服务、修理和其他服务业

-  
-

**P**

教育

-  
-

**Q**

卫生和社会工作

-

-

**R**

文化、体育和娱乐业

-

-

**S**

综合

-

-

合计

-

-

注：本基金本报告期末未持有股票。

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别

公允价值（人民币）

占基金资产净值比例（%）

**A 基础材料**

-

-

**B 消费者非必需品**

-

-

**C 消费者常用品**

-

-

**D 能源**

-

-

**E 金融**

-

-

**F 医疗保健**

-

-

**G 工业**

-

-

**H 信息技术**

-

-

**I 电信服务**

-

-

J 公用事业

-

-

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号

股票代码

股票名称

数量（股）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有股票。

报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号

股票代码

股票名称

本期累计买入金额

占期初基金资产净值比例（%）

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

金额单位：人民币元

序号

股票代码

股票名称

本期累计卖出金额

占期初基金资产净值比例（%）

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额

-

卖出股票收入（成交）总额

-

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

1,901,636.70
0.11
2
央行票据
-
-
3
金融债券
510,942,000.00
28.34
其中：政策性金融债
510,942,000.00
28.34
4
企业债券
902,223,700.70
50.04
5
企业短期融资券
-
-
6
中期票据
115,532,000.00
6.41
7
可转债（可交换债）
-
-
8
同业存单
-
-
9
其他
-
-
10
合计
1,530,599,337.40
84.89

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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（元）  
占基金资产净值比例（%）

1

160407  
16 农发 07  
3,000,000  
286,470,000.00  
15.89

2

1680076  
16 柳州投控债  
1,800,000  
172,782,000.00  
9.58

3

1680082  
16 建安债  
1,500,000  
144,075,000.00  
7.99

4

1680244  
16 浏阳城建债  
1,000,000  
97,090,000.00  
5.38

5

1680162  
16 宣城债  
1,000,000  
95,240,000.00  
5.28

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：注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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  
序号

贵金属代码  
贵金属名称  
数量（份）  
公允价值（元）  
占基金资产净值比例（%）



注：注：本基金本报告期末未持有贵金属。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值

公允价值变动

风险说明

公允价值变动总额合计

-

股指期货投资本期收益

-

股指期货投资本期公允价值变动

-

本基金投资股指期货的投资政策

-

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

-

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险指标说明

公允价值变动总额合计(元)

-

国债期货投资本期收益（元）

-

国债期货投资本期公允价值变动(元)

-

本期国债期货投资评价

-

投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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。

基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

-

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

16.54

2

应收证券清算款

-

3

应收股利

-

4

应收利息

21,322,320.63

5

应收申购款

-

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

21,322,337.17

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。

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。

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。

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

157  
11,454,721.71  
1,788,895,962.70  
99.47 %  
9,495,346.18  
0.53 %

圆信永丰兴利 C  
114  
3,054.39  
-

0.00 %  
348,199.90  
100.00 %

合计  
271  
6,637,415.16  
1,788,895,962.70  
99.45 %  
9,843,546.08  
0.55 %

期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

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

-  
0.0000 %

圆信永丰兴利 C  
1,000.38

0.2873 %

合计

1,000.38

0.0001 %

注：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）

。

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

发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-

-%

-

-%

-

基金管理人高级管理人员

-

-%

-

-%

-

基金经理等人员

-

-%

-

-%

-

基金管理人股东

-  
-%

-  
-%

-  
其他

-  
-%

-  
-%

-  
合计

-  
-%

-  
-%

-  
-

开放式基金份额变动

单位：份

项目

圆信永丰兴利

圆信永丰兴利 A

圆信永丰兴利 C

基金合同生效日（2016-02-23）的基金份额总额

-  
251,437,138.53

1,455,345.29

本报告期期初基金份额总额

-  
1,820,812,007.20

781,766.99

本报告期期间基金总申购份额

-  
58,032.85

36,576.79

减：本报告期期间基金总赎回份额

-  
22,478,731.17

470,143.88

本报告期期间基金拆分变动份额

-  
-  
-

本报告期末基金份额总额

1,798,739,508.78

1,798,391,308.88

348,199.90

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。

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。

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。

基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未改变。

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。

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。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

基金交易

债券交易

债券回购交易

权证交易

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

成交金额

占当期基金成交总额的比例

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

佣金

占当期佣金总量的比例

兴业证券

-  
-%  
-  
-%  
1,250,602.00  
100.00 %  
178,700,000.00  
100.00 %

-  
-%  
-  
-%

-  
国信证券  
2

-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%

-  
东兴证券  
2

-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%

-  
华福证券

2  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-

浙商证券

2  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-  
-%  
-

注：- 1. 本报告期内基金新增 4 个证券公司交易单元，分别为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。

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

圆信永丰基金管理有限公司关于旗下基金 2016 年年度资产净值的公告

证券日报

2017-01-01

2

圆信永丰基金管理有限公司关于调整旗下基金单笔申购、定期定额投资最低金额限制及单笔赎回、转换转出、持有份额最低限制的公告

证券日报

2017-01-20

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

1,788,895,861.97

1,788,895,861.97

99.450000 %

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。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

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。

存放地点

基金管理人、基金托管人处。

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>