

# 圆信永丰丰润货币市场基金 2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：圆信永丰基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 30 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 2018 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 3 月 10 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 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	5,194,404,207.60 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	19,051,398.92 份	5,175,352,808.68 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

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 3 月 10 日(基金合同生效日) -2017 年 12 月 31 日		2016 年		2015 年	
	丰润货币 A	丰润货币 B	丰润货币 A	丰润货币 B	丰润货币 A	丰润货币 B
本期已实现收益	380,730.20	143,662,645.43	-	-	-	-
本期利润	380,730.20	143,662,645.43	-	-	-	-
本期净值收益率	3.2986%	3.4982%	-	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
期末基金资产净值	19,051,398.92	5,175,352,808.68	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	-	-	-	-

注 1：本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

注 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。

注 3：本基金按日结转份额。

### 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	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

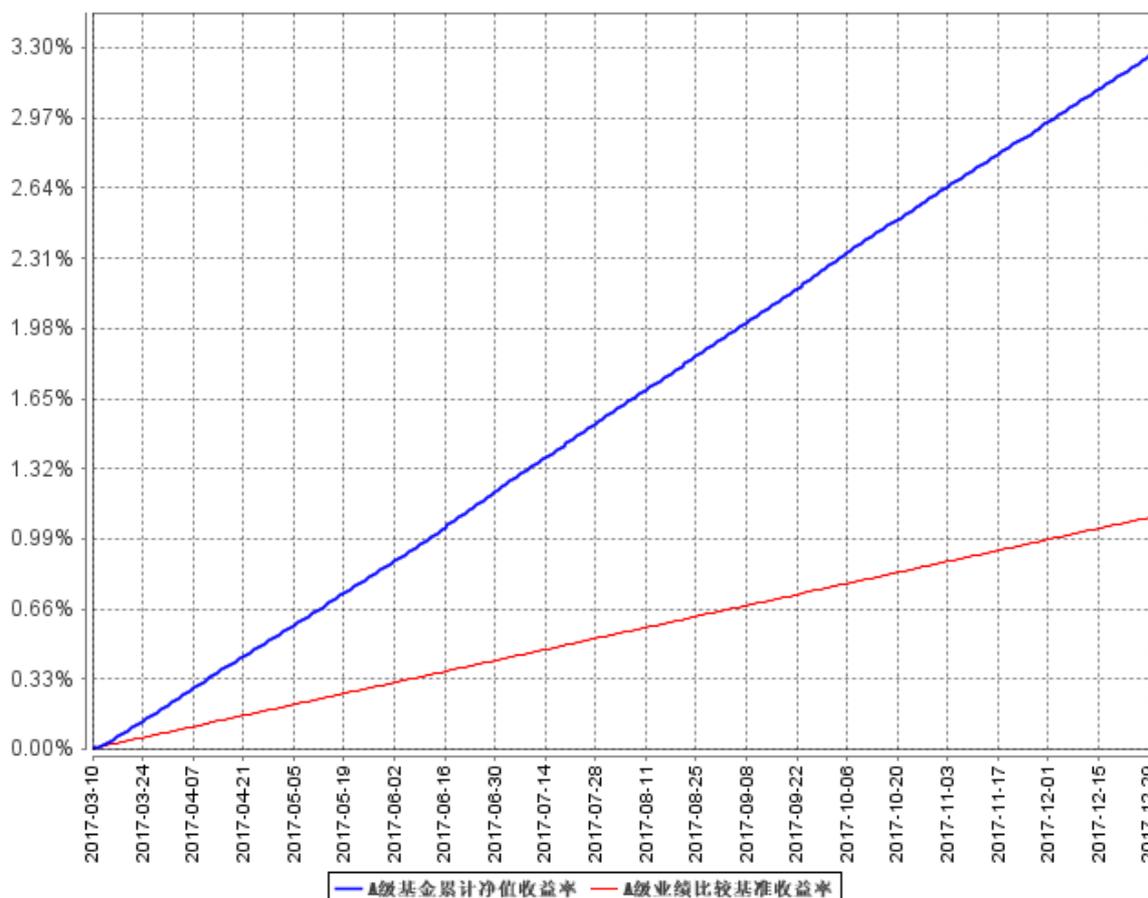
过去三个月	1.0148%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.6745%	0.0010%
过去六个月	2.0634%	0.0008%	0.6805%	0.0000%	1.3829%	0.0008%
自基金合同生效起至今	3.2986%	0.0010%	1.0985%	0.0000%	2.2001%	0.0010%

丰润货币 B

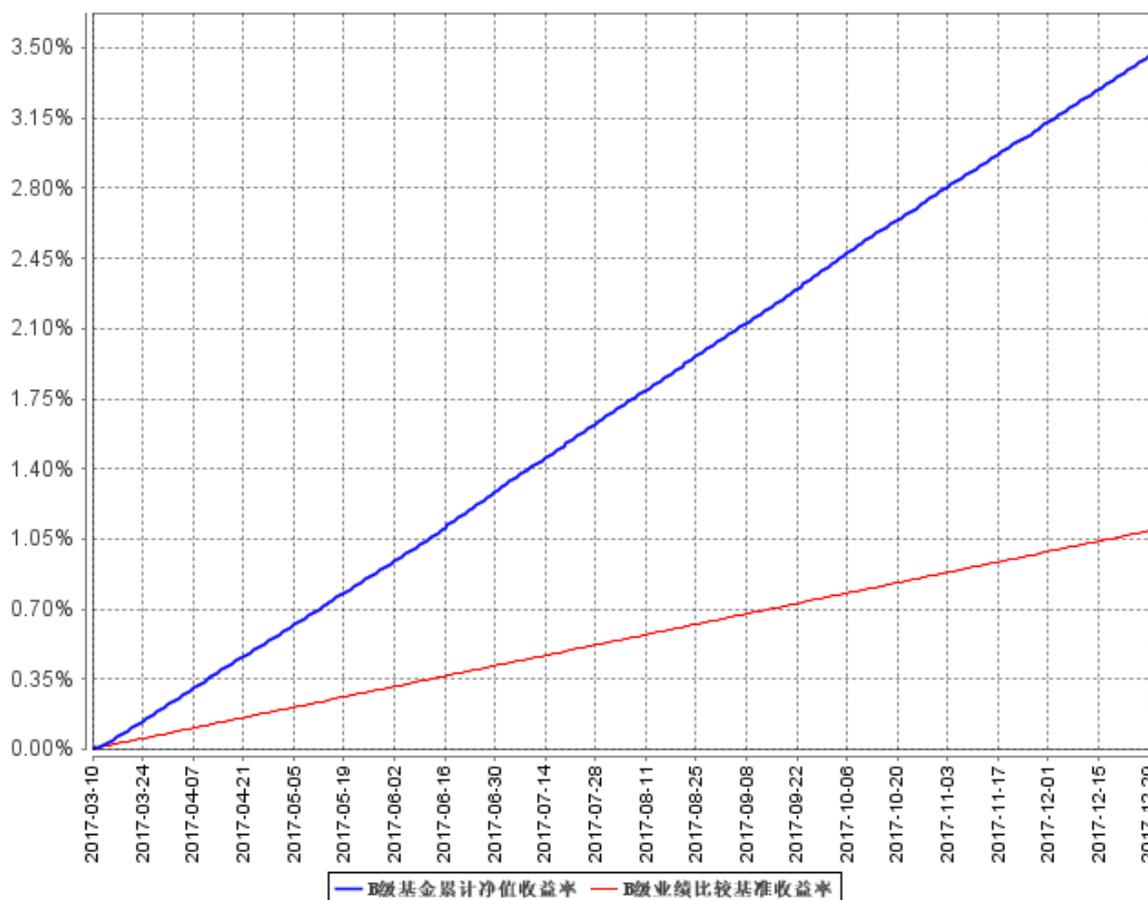
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.0757%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.7354%	0.0010%
过去六个月	2.1868%	0.0008%	0.6805%	0.0000%	1.5063%	0.0008%
自基金合同生效起至今	3.4982%	0.0011%	1.0985%	0.0000%	2.3997%	0.0011%

### 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



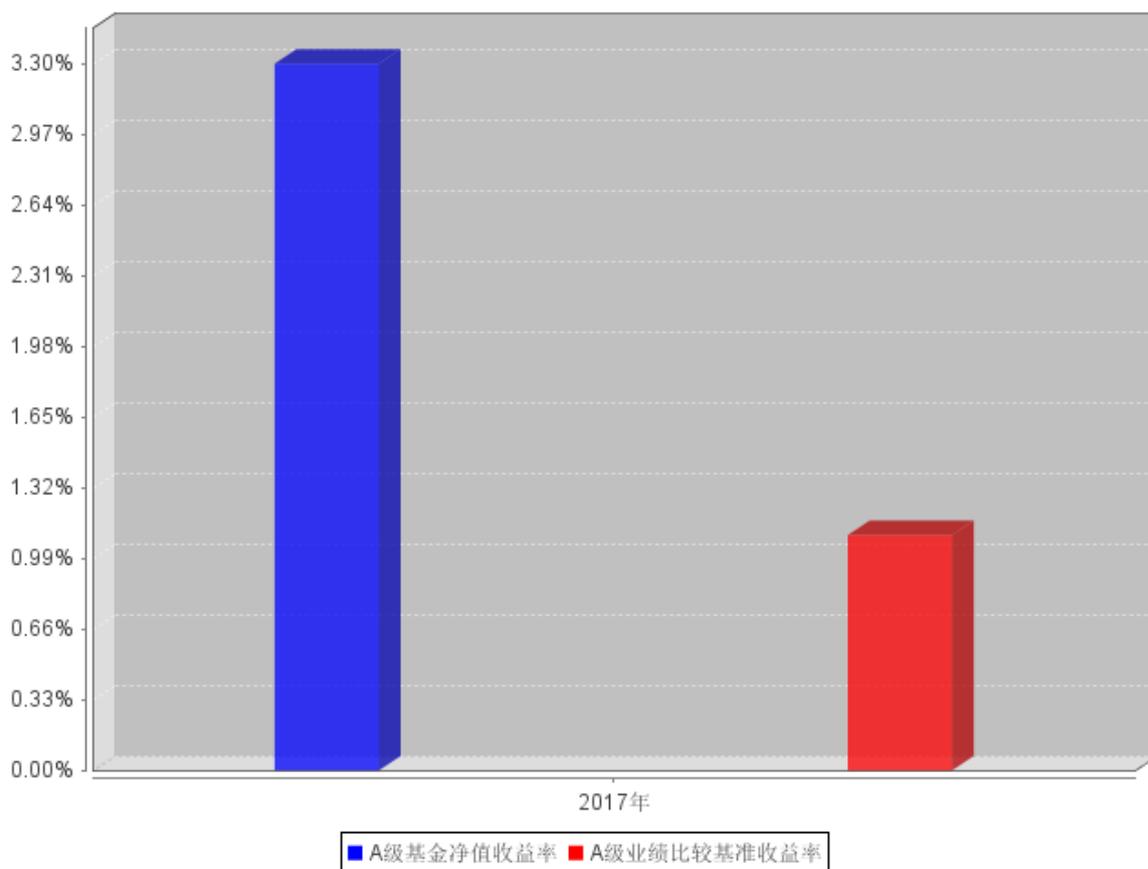
**B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



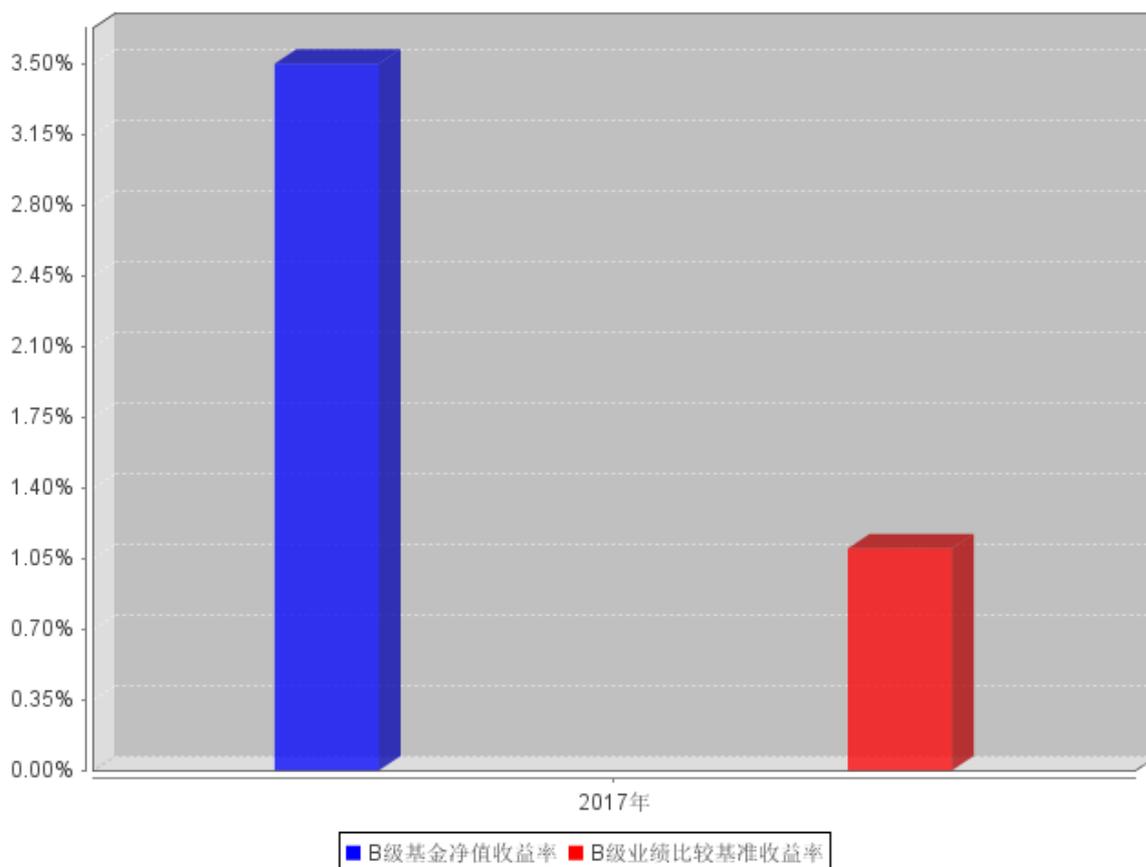
注：自基金合同生效后，截止报告期末，本基金成立不满一年。报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

### A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### B级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

丰润货币 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2017	372,269.93	-	8,460.27	380,730.20	注：-
合计	372,269.93	-	8,460.27	380,730.20	注：-
丰润货币 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2017	141,264,596.97	-	2,398,048.46	143,662,645.43	注：-
合计	141,264,596.97	-	2,398,048.46	143,662,645.43	注：-

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

圆信永丰基金管理有限公司是经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”或“证监会”）证监许可[2013]1514 号文批准，于 2014 年 1 月 2 日成立的合资基金管理公司。本公司由厦门国际信托有限公司与台湾永丰证券投资信托股份有限公司合资设立，持股比例分别为 51%和 49%，注册资本贰亿元人民币。公司注册地位于厦门，主要业务经营团队位于上海，是厦门首家证券投资基金管理公司，也是海西首家两岸合资的证券投资基金管理公司。

截止 2017 年 12 月 31 日，公司旗下共管理十二只开放式基金产品，包括一只股票型基金、六只混合型基金、四只债券型基金和一只货币市场基金。

#### 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。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格证。
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。国籍：中国，获得的相关业务

					资格：基金从业资格。
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。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格证。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求，制订了《圆信永丰基金管理有限公司公平交易管理办法》，规范公司旗下所有投资组合参与股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，同时贯穿了投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

公司执行自上而下的三级授权体系，依次为公募基金投资决策委员会、首席投资官、基金经理，基金经理在其授权范围内自主决策，公募基金投资决策委员会和首席投资官均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立科学客观的研究方法，同享研究资源和投资备选库为投资人员提供公平的投资机会，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动，不同投资组合在买卖同

一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易室询价机制，严格防范交易对手风险并抽检价格公允性；对于一级市场申购投资行为，遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

公司制订了《圆信永丰基金管理有限公司异常交易监控管理办法》，通过系统和人工、定量和定性相结合的方式进行投资交易行为的监控分析，并执行异常交易行为监控分析记录工作机制，确保公平交易可稽核。公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查，持续督促公平交易制度的落实执行并在实践中不断检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行上述公平交易制度和控制方法，开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的整体收益率差异、以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析，对以公司名义进行的一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控等，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中，在同向交易的监控和分析方面，根据法规要求，公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控，通过定期抽查前述的同向交易行为，定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势，重点关注任何可能导致不公平交易的情形。对于识别的异常情况，由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时，公司根据法规的要求，通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗内（T=1 日、T=3 日、T=5 日）的同向交易价差进行分析，采用概率统计方法，重点关注不同投资组合之间同向交易溢价率均值是否为零的 t 检验，以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。在一级市场证券申购和分配方面，事前对申购指令单进行审核监控，事后对以公司名义进行的申购报价单进行核查，确保分配结果符合公平交易的原则。

报告期内，通过前述分析方法，未发现公司旗下不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年，国内货币政策环境出现了明显变化，金融监管持续加强，货币基金整体收益受资金面波动影响较大。下半年受资管新规以及银行 MPA 考核影响，货币市场持续紧张，市场整体的流动性压力较大，这一状况在年末达到高峰。市场整体的利率期限曲线也明显受未来时间节点影响，呈现阶段性的波动。因此，资产配置上，在预留流动性需求基础上，期限内跟随利率曲线波动灵活调整资产配置。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期丰润货币 A 的基金份额净值收益率为 3.2986%，本报告期丰润货币 B 的基金份额净值收益率为 3.4982%，同期业绩比较基准收益率为 1.0985%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年展望：海外经济，欧美日发达国家经济体复苏持续性仍较强。伴随全球经济持续复苏和通胀回升，主要国家货币政策也从分化走向一致性趋紧。美联储年内预期渐进加息 2-3 次，欧日央行将逐步缩减 QE 并最终退出宽松。国内经济，尽管仍有外需支撑，但在 2018 年去杠杆攻坚战、防范化解全社会债务风险的阶段任务之下，今年投资需求和工业生产预计也将承受压力，特别是地方政府基建和房地产有一定下行压力，如果外需增长幅度不足以弥补内需下行态势，则宏观经济可能呈现出边际下行。物价方面，预计国内 CPI 中枢将抬升至 2.5%附近的温和通胀水平，主要是国际油价、国内下游消费品价格都可能呈现一定幅度的上涨。政策监管方面，在经济呈现明显下行之前预计货币政策保持稳健中性，央行暂时不会有大的放松动作。对于银行同业、理财及资管行业的监管细则还将持续出台。

债券市场利率仍将处于高位震荡，短期内因货币政策难现宽松，市场利率难以出现趋势性下行机会，债市投资以配置性为主。信用方面，投资主要集中在有收益安全边际、流动性的中高信用等级信用债，及未来一年以内有信用保障逻辑的信用品种。产业债配置偏向中下游产业的龙头企业，侧重于盈利确定性较强的上市公司和行业属性较为稳定的大型国企。城投债配置主要集中在沿海区域经济实力较强或有较大可能纳入地方政府债务置换范围的城投债。

## 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、首席运营官、研究部总监、监察稽核部总监、清算登记部总监和基金会计主管组成。估值委员会负责组织制定、评估和适时修订基金估值政策和程序，并指导和监督整个估值流程。估值委员会成员包括基金核算、行业研究等方面的业务骨干，均具有基金从业资格、专业胜任能力和丰富的工作经历且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理不属于公司估值委员会成员，不介入基金日常估值业务。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债数据估值服务；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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 20376 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	圆信永丰丰润货币市场基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了丰润货币 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计

	<p>报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于丰润货币，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>丰润货币的基金管理人圆信永丰基金管理有限公司管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估丰润货币的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非管理层计划清算丰润货币、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>丰润货币的基金管理人圆信永丰基金管理有限公司治理层负责监督丰润货币的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计一定会发现存在的重大错报。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对丰润货币持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致丰润货币不能持续经营。</p>

	(五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与丰润货币的基金管理人圆信永丰基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	陈迺迤
会计师事务所的地址	中国上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2018 年 3 月 27 日	

注：我们审计了圆信永丰丰润货币市场基金(以下简称“丰润货币”)的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		853,386,856.26	-
结算备付金		471,644.04	-
存出保证金		613.82	-
交易性金融资产		3,211,617,165.34	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,211,617,165.34	-
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		1,119,162,755.74	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		15,505,520.71	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,000,850.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-

资产总计		5,205,145,405.91	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		7,000,000.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		840,108.13	-
应付托管费		210,027.02	-
应付销售服务费		45,181.60	-
应付交易费用		97,424.97	-
应交税费		-	-
应付利息		8,779.74	-
应付利润		2,406,508.73	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		133,168.12	-
负债合计		10,741,198.31	-
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		5,194,404,207.60	-
未分配利润		-	-
所有者权益合计		5,194,404,207.60	-
负债和所有者权益总计		5,205,145,405.91	-

注：1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额

5,194,404,207.60 份，其中 A 类基金份额总额 19,051,398.92 份，B 类基金份额总额

5,175,352,808.68 份。

注：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 12 月 31 日止期间。

## 7.2 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 12 月 31 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	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
-----	-----	-------------------------------------	--------------------------------------

		12月31日	
<b>一、收入</b>		155,545,881.13	-
1.利息收入		156,127,068.04	-
其中：存款利息收入		61,118,350.02	-
债券利息收入		61,682,244.79	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		33,326,473.23	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-582,388.96	-
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-582,388.96	-
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）		1,202.05	-
<b>减：二、费用</b>		11,502,505.50	-
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	6,756,712.16	-
2. 托管费	7.4.8.2.2	1,689,178.17	-
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	360,288.13	-
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		2,480,159.59	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,480,159.59	-
6. 其他费用		216,167.45	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		144,043,375.63	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		144,043,375.63	-

### 7.3 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(基金合同生效日)至2017年12月31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12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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(本期净利润)	-	144,043,375.63	144,043,375.63
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)	3,393,407,807.07	-	3,393,407,807.07
其中：1.基金申购款	12,717,610,750.32	-	12,717,610,750.32
2.基金赎回款	-9,324,202,943.25	-	-9,324,202,943.25
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)	-	-144,043,375.63	-144,043,375.63
五、期末所有者权益(基金净值)	5,194,404,207.60	-	5,194,404,207.60
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-
-----------------	---	---	---

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>董晓亮</u>	<u>于娟</u>	<u>刘雪峰</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

圆信永丰丰润货币市场基金(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”)证监许可[2016]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。

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》,圆信永丰丰润货币基金根据销售服务费收取费率的不同,将基金份额分为不同的类别。年销售服务费率为0.25%的基金份额,称为A类基金份额;年销售服务费率为0.01%的基金份额,称为B类基金份额。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。

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,本基金投资于具有良好流动性的工具,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)。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《圆信永丰丰润货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

-

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值

税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
圆信永丰基金管理有限公司(“圆信永丰基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
台湾永丰证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,756,712.16	-
其中：支付销售机构的客户维护费	2,534.30	-

注：支付给管理人的管理费计算标准：每日应计提的基金管理费=前一日的基金资产净值  
x0.2%/当年天数。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年3月10日(基金合同生效日)至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,689,178.17	-

注：支付给管理人的托管费计算标准：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值  
x0.05%/当年天数。

**7.4.8.2.3 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12月31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	21,061.10	337,148.24	358,209.34
兴业银行	2,043.14	166.64	2,209.78
合计	23,104.24	337,314.88	360,419.12
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12月31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

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%。对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级之日起的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。

本基金 B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%。对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，

年销售服务费率应自其升级之日起的下一个工作日起适用 B 类基金份额的费率。

基金份额的销售服务费计算标准如下：

每日应计提的基金份额的销售服务费=前一日基金份额的基金资产净值 x 年销售服务费率/当年天数

#### 7.4.8.3 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 年 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日						
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
兴业银行	-	49,840,243.55	-	-	980,645,000.00	259,067.25
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日						
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

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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 3 月 10 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	丰润货币 A	丰润货币 B
基金合同生效日（ 2017 年 3 月 10 日）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	-	119,261,963.25
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	54,016,575.06
期末持有的基金份额	-	65,245,388.19
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	1.2600%



注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

注：2. 基金管理人圆信永丰基金在本年度申购/赎回本基金的交易委托圆信永丰直销柜台办理。

#### 7.4.8.4.2 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 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
厦门信托	350,506,002.01	6.7726%	-	-
兴业银行	1,927,653,221.07	37.2468%		

#### 7.4.8.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行-活期	8,386,856.26	544,144.32	-	-
兴业银行-定期	80,000,000.00	3,722,212.14		

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.10 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 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 3,211,617,165.34 元，无属于第一及第三层次的余额。

###### (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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## (2) 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，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。

根据财政部、国家税务总局于 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 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要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	3,211,617,165.34	61.70
	其中：债券	3,211,617,165.34	61.70
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,119,162,755.74	21.50
	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	853,858,500.30	16.40
4	其他各项资产	20,506,984.53	0.39
5	合计	5,205,145,405.91	100.00

## 8.2 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	1.79	
	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	7,000,000.00	0.13
	其中:买断式回购融资	-	-

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

--	--	--	--	--

注:在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资产净值的 20%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	101
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

--	--	--	--	--

注:报告期内,本基金投资组合平均剩余期限不存在超过 120 天的情况。

### 8.3.2 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	48.05	0.13
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	16.20	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮	-	-

	动利率债		
3	60 天(含)—90 天	1.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	10.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	23.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.81	0.13

#### 8.4 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，本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 240 天的情况。

#### 8.5 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	79,955,405.32	1.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	319,564,784.68	6.15
	其中：政策性金融债	319,564,784.68	6.15
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,812,096,975.34	54.14
8	其他	-	-
9	合计	3,211,617,165.34	61.83
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 8.6 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	111786605	17 徽商银行 CD158	1,500,000	149,688,232.51	2.88
2	111781386	17 天津银行 CD142	1,300,000	129,726,046.02	2.50
3	111781647	17 重庆农村商行 CD150	1,000,000	97,463,981.69	1.88
4	111780952	17 贵阳银行 CD092	800,000	79,900,148.29	1.54
5	111786824	17 常熟农村商行 CD206	800,000	79,817,818.80	1.54
6	170410	17 农发 10	700,000	69,887,665.51	1.35
7	111719289	17 恒丰银行 CD289	700,000	67,809,221.90	1.31
8	111719218	17 恒丰银行 CD218	600,000	59,880,825.08	1.15
9	111781886	17 河北银行 CD061	600,000	59,161,999.09	1.14
10	111780850	17 贵阳银行 CD091	500,000	49,943,892.03	0.96

## 8.7 “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	0.0492%
报告期内偏离度的最低值	-0.1246%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0231%

### 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。

## 8.8 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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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	613.82
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	15,505,520.71
4	应收申购款	5,000,850.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	20,506,984.53

### 8.9.2 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
丰润货币 A	324	58,800.61	13,431,800.81	70.50%	5,619,598.11	29.50%
丰润货币 B	36	143,759,800.24	5,175,352,808.68	100.00%	0.00	0.00%
合计	360	14,428,900.58	5,188,784,609.49	99.89%	5,619,598.11	0.11%

### 9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	1,560,870,817.78	30.05%
2	银行类机构	366,782,403.29	7.06%
3	信托类机构	350,290,150.42	6.74%
4	保险类机构	297,573,373.02	5.73%
5	保险类机构	204,425,767.17	3.94%
6	证券类机构	203,021,075.21	3.91%
7	保险类机构	201,765,557.19	3.88%
8	其他机构	200,052,146.95	3.85%
9	保险类机构	161,289,679.88	3.11%
10	保险类机构	150,056,395.57	2.89%

### 9.4 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	891,729.43	4.6807%
	丰润货币 B	-	-
	合计	891,729.43	0.0172%

### 9.5 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

注：报告期末基金管理人的从业人员持有开放式基金份额总量区间为 50~100 万份（含）。

## § 10 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	42,903,798.75	12,674,706,951.57
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总 赎回份额	24,792,800.36	9,299,410,142.89
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	19,051,398.92	5,175,352,808.68

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。本年度支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 6.66 万元。该审计机构已提供审计服务的持续年限为 1 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

注：1. 本报告期内基金新增 18 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，中信证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，西部证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，中泰证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，长江证券股份有限公司上交所及深交所交易单元。

注：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。

注：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。

### 11.7.2 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	97,868,101.55	100.00%	9,960,200,000.00	100.00%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

--	--	--	--	--

注：本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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 - 2017年12月31日	1,800,056,000.00	42,675,956.53	281,861,138.75	1,560,870,817.78	30.05%
	2	2017年3月15日 - 2017年5月22日	500,000,000.00	6,199,760.61	-	506,199,760.61	9.74%
个	-	-	-	-	-	-	-

人																						
产品特有风险																						
<p>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。</p>																						

## 12.2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  
2018 年 3 月 30 日