

---

# 圆信永丰瑞丰 66 个月定期开放债券型证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 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:2022 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 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的法律责任。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2022年3月30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2021年03月16日起至2021年12月31日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §2 基金简介                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 6  |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况                 | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 9  |
| §4 管理人报告                                | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11 |
| 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             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14 |
| 4.9 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       | 14 |
| §5 托管人报告                                | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15 |
| §6 审计报告                                 | 15 |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 15 |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 15 |
| §7 年度财务报表                               | 18 |
| 7.1 资产负债表                               | 18 |
| 7.2 利润表                                 | 19 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 21 |
| 7.4 报表附注                                | 22 |
| §8 投资组合报告                               | 43 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 43 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 44 |
| 8.3 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       | 44 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 44 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 44 |
| 8.6 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      | 45 |
| 8.7 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   | 45 |
| 8.8 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   | 45 |
| 8.9 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      | 45 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 45 |

|   |    |
|---|----|
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....          | 45 |
| 8.12 投资组合报告附注.....                      | 46 |
| §9 基金份额持有人信息.....                       | 47 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 47 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 47 |
| 9.3 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.....   | 47 |
| §10 开放式基金份额变动.....                      | 47 |
| §11 重大事件揭示.....                         | 47 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 47 |
| 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.....   | 48 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 48 |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                     | 48 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 48 |
| 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.....      | 48 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 48 |
| 11.8 其他重大事件.....                        | 51 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 52 |
| 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..... | 52 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 53 |
| §13 备查文件目录.....                         | 53 |
| 13.1 备查文件目录.....                        | 53 |
| 13.2 存放地点.....                          | 53 |
| 13.3 查阅方式.....                          | 53 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 基金名称       | 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 圆信永丰瑞丰                  |
| 基金主代码      | 011101                  |
| 基金运作方式     | 契约型定期开放式                |
| 基金合同生效日    | 2021年03月16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 | 5,999,022,851.23份       |
| 基金合同存续期    | 不定期                     |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。  |
| 投资策略   | 本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期内原则上采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期。在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。本基金的投资策略包括封闭期配置策略、杠杆投资策略、封闭期现金管理策略、开放期投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的三年期银行定期存款利率（税后）+1.25%。  |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，但高于货币市场基金。   |

### 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<br>负责人 | 姓名   | 兰文伟  | 龚小武                   |
|             | 联系电话 | 021-60366000                                       | 021-52629999-212056   |
|             | 电子邮箱 | service@gtsfund.com.cn                             | gongxiaowu@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<br>厦门片区（保税港区）海景南<br>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152<br>8号陆家嘴基金大厦19楼                     | 上海市银城路167号兴业大厦<br>4楼  |
| 邮政编码        |      | 200122   | 200120                |
| 法定代表人       |      | 洪文瑾  | 吕家进                   |

#### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报   |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gtsfund.com.cn/">http://www.gtsfund.com.cn/</a> |
| 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  |

#### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                       | 办公地址                         |
|--------|--------------------------|------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所<br>（特殊普通合伙） | 上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼        |
| 注册登记机构 | 圆信永丰基金管理有限公司             | 中国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

|                      |                                     |
|----------------------|-------------------------------------|
| <b>3.1.1 期间数据和指标</b> | 本期2021年03月16日（基金合同生效日）- 2021年12月31日 |
| 本期已实现收益              | 180,957,068.38                      |
| 本期利润                 | 180,957,068.38                      |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0302                              |
| 本期加权平均净值利润率          | 2.99%                               |
| 本期基金份额净值增长率          | 3.04%                               |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 2021年末                              |
| 期末可供分配利润             | 18,983,451.52                       |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0032                              |
| 期末基金资产净值             | 6,018,006,302.75                    |
| 期末基金份额净值             | 1.0032                              |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 2021年末                              |
| 基金份额累计净值增长率          | 3.04%                               |

注1：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。

注2：对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

注3：上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

注4：本基金自基金合同生效日为2021年03月16日，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

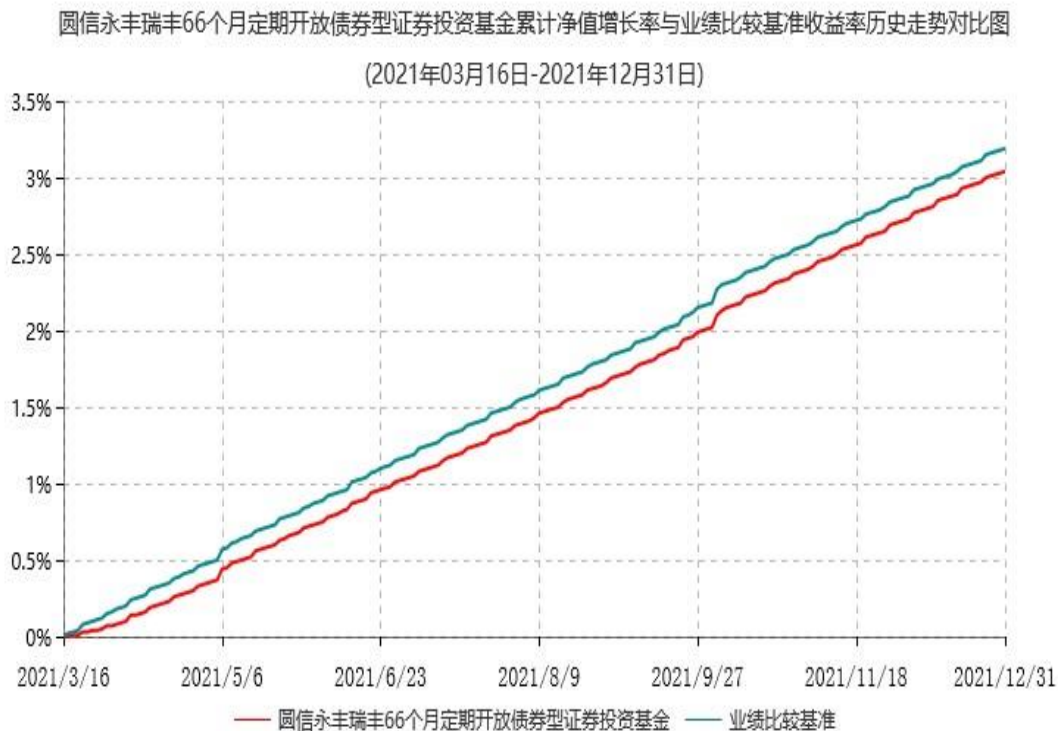
## 3.2 基金净值表现

## 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

| 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   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.00%    | 0.01%       | 1.01%      | 0.01%         | -0.01% | 0.00% |

|            |       |       |       |       |        |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去六个月      | 1.99% | 0.01% | 2.02% | 0.01% | -0.03% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.04% | 0.01% | 3.19% | 0.01% | -0.15% | 0.00% |

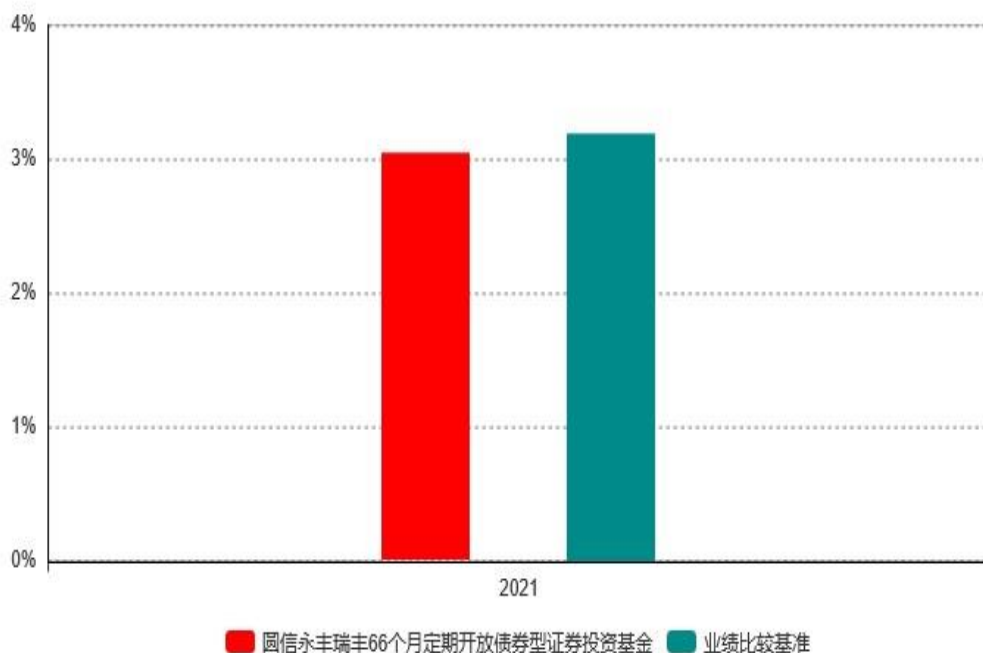
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：自基金合同生效后，截止报告期末，本基金成立不满一年；本基金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





注：本基金合同生效日为2021年03月16日，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

| 年度    | 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 | 年度利润分配合计       | 备注 |
|-------|-------------|----------------|-----------|----------------|----|
| 2021年 | 0.270       | 161,973,589.82 | 27.08     | 161,973,616.90 | -  |
| 合计    | 0.270       | 161,973,589.82 | 27.08     | 161,973,616.90 | -  |

## § 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2021年12月31日，公司旗下共管理28只开放式基金产品，包括3只股票型基金、18只混合型基金、6只债券型基金和1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 | 2021-03-16      | -    | 12年    | 厦门大学经济学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司固收投资部总监。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、固收投资部副总监。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格。 |

注1：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。

注2：林铮的“任职日期”为基金合同生效之日。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在风险可控的前提下为基金份额持有人谋求最大利益。基金管理人遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、该基金基金合同的规定。基金经理对个券和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

### 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

报告期内，基金管理人贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和《圆信永丰基金管理有限公司公平交易管理办法》的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保基金管理人管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。基金管理人各类基金资产、资产管理计划资产独立运作。对于交易所市场投资，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照价格优先、时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资，基金管理人通过交易对手控制和询价机制，严格防范对手风险并抽检价格公允性；对于申购投资行为，基金管理人遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

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

#### 4.3.2 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

2021年全年国内债券市场无风险利率呈现震荡下行的特点，10年国债收益率全年下行39个bp。上半年，基本面方面，经济增长维持高位，但景气度出现了回落；通胀方面，虽然通胀数值持续走高，但市场预期通胀整体可控且将回落。货币政策方面，除了1月份因财政资金投放较晚且货币政策对冲不及时造成市场资金利率出现大幅波动外，政策整体维持相对宽松，在政府债券发行明显后置叠加金融机构配置需求较大导致市场供需较好的背景下，上半年市场利率呈现冲高后，走势持续回落；

下半年，随着降准落地以及地方债券供给持续弱于预期的影响下，三季度债券市场整体收益率下行明显。但随着央行持续稳健的公开市场操作，叠加降息预期落空，市场对于宽松预期出现了变化，短端利率逐步抬升，四季度债券收益率整体维持一个震荡状态，这一状态持续到12月份的再度降准降息，货币政策进一步放松推动利率收在了年内低位。

在预期债券收益率将持续走低的背景下，本产品在成立之后的两个月内，将产品仓位快速提升至合适的位置，使得组合整体静态收益维持在合适的水平，从而能获取较优的利差收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰瑞丰基金份额净值为1.0032元，本报告期内，基金份额净值增长率为3.04%，同期业绩比较基准收益率为3.19%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年，国内稳增长的目标明确，但从经济走势趋势上看，稳增长的压力较大：2021年海外需求超预期一直是经济增长的拉动项，但随着海外经济复苏和恢复，生产替代的逻辑可能存在变化；国内需求方面，受疫情影响，居民消费受到明显的影响，新冠变异引发的疫情扩散一定程度上压制国内需求恢复；投资上看，房地产市场在持续的政策调控下，趋势短期不容乐观，三季度之前房地产投资触底企稳的难度仍然较大，预期对于经济拖累较大，制造业投资增速虽然较高，但一旦经济持续疲弱，则将影响资本未来的投资预期；因此2022年政府投资驱动将对经济的稳定有着比较重要的作用。

从政策展望上看，上半年为了稳定经济增速，预计宽信用的政策将进一步发力。从政府工作报告内容上看，进一步财政支出用以刺激经济需求以及投资，有望出台更多的政策；另一方面，货币政策对于稳信用的配合在上半年相对确定。但随着海外央行货币政策收紧，叠加通胀上行的制约，货币政策未来宽松的空间将随着时间推移以及经济企稳会明显收缩。

基于以上因素，对于国内债券市场，我们判断有利于利率持续下行的政策空间以及窗口都比较有限，而一旦宽信用的效果比较确定反映在经济数据中，叠加海外利率上升对于国内收益率的不利影响将较大；另一方面，货币政策整体维持相对宽松的确定性仍然较强，而宽信用趋势下，市场整体信用风险会有所降低。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021年，基金管理人牢记“受人之托、代人理财”的初心，忠实履行“诚实守信、勤勉尽责”这一职业操守的底线。公司监察稽核工作以“提升合规服务、推进业务发展、保障稳健经营、提升内控水平、保障投资者合法权益”为总体目标，秉承以合规促进发展、以服务创造价值的理念，按照工作计划结合实际情况对公司各项业务进行全面的监察稽核工作，保障和促进公司各项业务合法合规运作。报告期内，基金管理人内部监察稽核工作贯穿三条主线：

1、紧抓员工行为、公平交易、利益冲突、营销规范等方面的日常监控，积极防范内幕交易，坚守合规底线不动摇。做好以事前防范为主的合规服务，积极避免合规风险；做好对高风险业务高频率的合规监控，及时发现合规风险。

2、迎合监管政策变化，动态调整合规风控工作。报告期内，基金管理人重视信用风险、流动性风险等投资风险的监督，并积极防范运营过程中的操作风险。针对风险控制的需求和重点，加强事前风险识别，注重事中风险监控，强化事后稽核力度，提高工作水平。做好有重点的专项审计，针对性地发现内控薄弱环节。

3、及时跟踪行业监管动向，发布更新监管动态，结合新法规实施、新监管要求落实以及公司业务发展的实际情况，辅以外部专业机构的实务经验和专业优势，推动和完善公司相关制度流程的建立、健全，防范日常运作中的违规行为发生。提供多样化的合规培训，提高员工的合规意识；营造合规氛围，组织全员参与合规宣传培训活动。

报告期内，基金管理人各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施不断完善并积极发挥作用。本基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。我们将继续以合规运作和风险管理为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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、清算登记部分管领导、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。

#### 4.8 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，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的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2次，实际分配金额为161,973,616.90元。

#### 4.9 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情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本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(2022)第21824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 | 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人   |
| 审计意见    | （一）我们审计的内容 我们审计了圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“圆信永丰瑞丰基金”)的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年3月16日(基金合同生效日)至2021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。（二）我们的意见 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 |

|                 |   |
|-----------------|---|
|                 | 映了圆信永丰瑞丰基金2021年12月31日的财务状况以及2021年3月16日(基金合同生效日)至2021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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于圆信永丰瑞丰基金，并履行了职业道德方面的其他责任。   |
| 强调事项            | 无。  |
| 其他事项            | 无。  |
| 其他信息            | 无。  |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 圆信永丰瑞丰基金的基金管理人圆信永丰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)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。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估圆信永丰瑞丰基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算圆信永丰瑞丰基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督圆信永丰瑞丰基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 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在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于  |



|           |   |     |
|-----------|---|-----|
|           | <p>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。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：（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。（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。（三）评价基金管理人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。（四）对基金管理人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，就可能导致对圆信永丰瑞丰基金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圆信永丰瑞丰基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人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。</p> |     |
| 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  | 张炯  | 张晓阳 |

|           |                       |
|-----------|-----------------------|
| 会计师事务所的地址 | 上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼 |
| 审计报告日期    | 2022-03-29            |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021年12月31日 |
|-----------------|------------|--------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                    |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 1,511,829.47       |
| 结算备付金           |            | -                  |
| 存出保证金           |            | -                  |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | -                  |
| 其中：股票投资         |            | -                  |
| 基金投资            |            | -                  |
| 债券投资            |            | -                  |
| 资产支持证券投资        |            | -                  |
| 贵金属投资           |            | -                  |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                  |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                  |
| 应收证券清算款         |            | -                  |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 111,252,824.76     |
| 应收股利            |            | -                  |
| 应收申购款           |            | -                  |
| 递延所得税资产         |            | -                  |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | 10,251,182,010.43  |
| 资产总计            |            | 10,363,946,664.66  |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末</b>         |

|               |          | 2021年12月31日       |
|---------------|----------|-------------------|
| <b>负 债:</b>   |          |                   |
| 短期借款          |          | -                 |
| 交易性金融负债       |          | -                 |
| 衍生金融负债        | 7.4.7.3  | -                 |
| 卖出回购金融资产款     |          | 4,342,416,172.76  |
| 应付证券清算款       |          | -                 |
| 应付赎回款         |          | -                 |
| 应付管理人报酬       |          | 767,864.82        |
| 应付托管费         |          | 255,954.94        |
| 应付销售服务费       |          | -                 |
| 应付交易费用        | 7.4.7.7  | 130,873.22        |
| 应交税费          |          | -                 |
| 应付利息          |          | 2,149,496.17      |
| 应付利润          |          | -                 |
| 递延所得税负债       |          | -                 |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 220,000.00        |
| 负债合计          |          | 4,345,940,361.91  |
| <b>所有者权益:</b> |          |                   |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 5,999,022,851.23  |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 18,983,451.52     |
| 所有者权益合计       |          | 6,018,006,302.75  |
| 负债和所有者权益总计    |          | 10,363,946,664.66 |

注1: 报告截止日2021年12月31日, 基金份额净值1.0032元, 基金份额总额5,999,022,851.23份。

注2: 本财务报表的实际编制期间为2021年3月16日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间。

注3: 资产负债表中其他资产为分类为持有至到期投资的债券投资。

## 7.2 利润表

会计主体: 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期: 2021年03月16日(基金合同生效日)至2021年12月31日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2021年03月16日（基金合同<br>生效日）至2021年12月31<br>日 |
|------------------------|------------|--|
| <b>一、收入</b>            |            | 258,332,562.42                                 |
| 1. 利息收入                |            | 258,332,562.42                                 |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 489,301.07                                     |
| 债券利息收入                 |            | 254,559,740.78                                 |
| 资产支持证券利息收入             |            | -  |
| 买入返售金融资产收入             |            | 3,283,520.57                                   |
| 证券出借利息收入               |            | -  |
| 其他利息收入                 |            | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -  |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -  |
| 基金投资收益                 | 7.4.7.13   | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.14   | -  |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.14.3 | -  |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.15   | -  |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.16   | -  |
| 股利收益                   | 7.4.7.17   | -  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18   | -  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.19   | -  |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 77,375,494.04                                  |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 7,202,750.00                                   |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 2,400,916.71                                   |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.2.3 | -  |
| 4. 交易费用                | 7.4.7.20   | -  |
| 5. 利息支出                |            | 67,535,159.62                                  |

|                            |          |                       |
|----------------------------|----------|-----------------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 67,535,159.62         |
| 6. 税金及附加                   |          | -                     |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.21 | 236,667.71            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>180,957,068.38</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>180,957,068.38</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021年03月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

| 项 目                               | 本期<br>2021年03月16日（基金合同生效日）至2021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）                   | 5,999,022,824.19                       | -               | 5,999,022,824.19 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                      | 180,957,068.38  | 180,957,068.38   |
| 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） | 27.04                                  | 0.04            | 27.08            |
| 其中：1. 基金申购款                       | 27.04                                  | 0.04            | 27.08            |
| 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            | -                                      | -161,973,616.90 | -161,973,616.90  |

|                  |                  |               |                  |
|------------------|------------------|---------------|------------------|
| 值变动（净值减少以“-”号填列） |                  |               |                  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）  | 5,999,022,851.23 | 18,983,451.52 | 6,018,006,302.75 |

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：

蔡炎坤

姚德明

刘雪峰

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

圆信永丰瑞丰66个月定期开放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[2020]第3479号《关于准予圆信永丰瑞丰66个月定期开放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《圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,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5,999,022,336.23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(2021)第0244号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2021年3月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,999,022,824.19份基金份额,其中认购资金利息折合487.96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。

本基金以封闭期和开放期滚动的方式运作。本基金的封闭期为自基金合同生效之日(含)起或自每一开放期结束之日的次日(含)起66个月后月度对日(指日历月,如该日为非工作日或无对应日期,则顺延至下一个工作日)的前一日。本基金自封闭期结束之日的下一个工作日起进入开放期,期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期不少于5个工作日且最长不超过20个工作日,封闭期内不办理申购和赎回业务,也不上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括债券(包括国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、同业存单、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)。本基金不投资股票、

可转换债券、可交换债券。本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于80%，应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每个开放期开始前3个月、开放期及开放期结束后3个月内，本基金的债券资产投资比例不受上述限制。开放期内，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，在封闭期内本基金不受前述5%的限制；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为：该封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的三年期银行定期存款利率(税后)+1.25%。

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2022年3月29日批准报出。

#### 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<年度报告和中期报告>》、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》、《圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年3月16日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的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2021年12月31日的财务状况以及2021年3月16日(基金合同生效日)至2021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

##### 7.4.4.1 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2021年3月16日(基金合同生效日)至2021年12月31日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 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以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及可供出售金融资产。

本基金采用买入持有至到期投资策略投资的债券投资分类为持有至到期投资。持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且本基金有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。

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。

#### 7.4.4.4 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。应收款项、持有至到期投资和其他金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；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。

对于应收款项、持有至到期投资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。

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。相应的资产减值损失在利润表中列示在其他费用科目下。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。但是，该转回后的账面价值不应当超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

不适用。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率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及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

于持有至到期投资处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

持有至到期投资是否减值在很大程度上依赖于基金管理人的判断。本基金的基金管理人定期审阅持有至到期投资以评估其是否出现减值情况，并在出现减值情况时评估减值损失的具体金额。发生减值的客观证据包括评估日该金融工具可观察的市场价值出现严重下跌，发行方发生严重财务困难使该金融资产无法在活跃市场继续交易、无法履行合同条款(例如，无法按期偿付利息或本金)等。在进行判断的过程中，本基金的基金管理人需评估发生减值的客观证据对该项投资预计未来现金流的影响。

### 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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2021年12月31日 |
|------|--------------------|
| 活期存款 | 1,511,829.47       |

|              |              |
|--------------|--------------|
| 定期存款         | -            |
| 其中：存款期限1个月以内 | -            |
| 存款期限1-3个月    | -            |
| 存款期限3个月以上    | -            |
| 其他存款         | -            |
| 合计           | 1,511,829.47 |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

无余额。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021年12月31日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 240.65             |
| 应收定期存款利息   | -                  |
| 应收其他存款利息   | -                  |
| 应收结算备付金利息  | -                  |
| 应收债券利息     | 111,252,584.11     |
| 应收资产支持证券利息 | -                  |
| 应收买入返售证券利息 | -                  |
| 应收申购款利息    | -                  |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                  |

|          |                |
|----------|----------------|
| 应收出借证券利息 | -              |
| 其他       | -              |
| 合计       | 111,252,824.76 |

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目      | 本期末<br>2021年12月31日 |
|---------|--------------------|
| 其他应收款   | -                  |
| 待摊费用    | -                  |
| 持有至到期投资 | 10,251,182,010.43  |
| 合计      | 10,251,182,010.43  |

注：于2021年12月31日，本基金持有的持有至到期投资均为银行间市场债券投资，上述持有至到期投资均无需计提减值准备。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                  |
| 银行间市场应付交易费用 | 130,873.22         |
| 合计          | 130,873.22         |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | -                  |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 预提审计费       | 120,000.00         |
| 预提信息披露费     | 100,000.00         |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 220,000.00 |
|----|------------|

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年03月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |                  |
|---------------|--|------------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额             |
| 基金合同生效日       | 5,999,022,824.19                       | 5,999,022,824.19 |
| 本期申购          | 27.04                                  | 27.04            |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                      | -                |
| 本期末           | 5,999,022,851.23                       | 5,999,022,851.23 |

注1：申购为红利再投份额。

注2：本基金自2021年2月22日至2021年3月15日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币5,999,022,336.23元，折合为5,999,022,336.23份基金份额。根据《圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币487.96元在本基金成立后，折合为487.96份基金份额，划入基金份额持有人账户。

注3：根据《圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及《圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》的相关规定，本基金的封闭期为自基金合同生效之日（含）起或自每一开放期结束之日的次日（含）起66个月后月度对日（指日历月，如该日为非工作日或无对应日期，则顺延至下一个工作日）的前一日。本基金自封闭期结束之日的下一个工作日起进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期不少于5个工作日且最长不超过20个工作日，封闭期内不办理申购和赎回业务，也不上市交易。

#### 7.4.7.10 未分配利润

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        |
|-----------|----------------|-------|----------------|
| 基金合同生效日   | -              | -     | -              |
| 本期利润      | 180,957,068.38 | -     | 180,957,068.38 |
| 本期基金份额交易产 | 0.04           | -     | 0.04           |

|          |                 |   |                 |
|----------|-----------------|---|-----------------|
| 生的变动数    |                 |   |                 |
| 其中：基金申购款 | 0.04            | - | 0.04            |
| 基金赎回款    | -               | - | -               |
| 本期已分配利润  | -161,973,616.90 | - | -161,973,616.90 |
| 本期末      | 18,983,451.52   | - | 18,983,451.52   |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年03月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|-----------|--|
| 活期存款利息收入  | 137,594.71                             |
| 定期存款利息收入  | 266,000.01                             |
| 其他存款利息收入  | -                                      |
| 结算备付金利息收入 | 85,706.35                              |
| 其他        | -                                      |
| 合计        | 489,301.07                             |

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

无。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

无。

**7.4.7.15 贵金属投资收益**

无。

**7.4.7.16 衍生工具收益**

无。

**7.4.7.17 股利收益**

无。

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

无。

**7.4.7.19 其他收入**

无。

**7.4.7.20 交易费用**

无。

**7.4.7.21 其他费用**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年03月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|---------|--|
| 审计费用    | 120,000.00                             |
| 信息披露费   | 100,000.00                             |
| 证券出借违约金 | -                                      |
| 汇划手续费   | 7,267.71                               |
| 账户维护费   | 9,000.00                               |
| 开户费     | 400.00                                 |
| 合计      | 236,667.71                             |

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**



无。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

本报告期不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。

| 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               |
| 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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021年03月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |              |
|-----------------|--|--------------|
|                 | 当期发生的基金应支付的管理费                         | 7,202,750.00 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 18,008.46                              |              |

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0.15%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年03月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |              |
|----|--|--------------|
|    | 当期发生的基金应支付的托管费                         | 2,400,916.71 |

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0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 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<br>2021年03月16日（基金合同生效日）至2021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                                   | 2,139,809,749.86 | -    | -     | -    | 47,672,260,000.00 | 9,310,479.12 |

## 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

## 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 7.4.10.5.2 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2021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 |
| 兴业银行  | 2,499,999,000.00   | 41.67%           |

## 7.4.10.6 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<br>2021年03月16日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |            |
|-----------|--|------------|
|           | 期末余额                                   | 当期利息收入     |
| 兴业银行-活期存款 | 1,511,829.47                           | 137,594.71 |

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。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日      | 除息日            | 每10份基<br>金<br>份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额       | 再投资形<br>式发放总<br>额 | 本期利润<br>分配合计       | 备注 |
|----|----------------|----------------|-------------------------|--------------------|-------------------|--------------------|----|
| 1  | 2021-09<br>-14 | 2021-09<br>-14 | 0.170                   | 101,983,37<br>1.42 | 16.95             | 101,983,38<br>8.37 | -  |
| 2  | 2021-12<br>-10 | 2021-12<br>-10 | 0.100                   | 59,990,21<br>8.40  | 10.13             | 59,990,22<br>8.53  | -  |
| 合计 |                |                | 0.270                   | 161,973,58<br>9.82 | 27.08             | 161,973,61<br>6.90 | -  |

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金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4,342,416,172.76元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称   | 回购到期日      | 期末估<br>值单价 | 数量（张）          | 期末估值总额               |
|--------|--------|------------|------------|----------------|----------------------|
| 160213 | 16国开13 | 2022-01-04 | 98.44      | 18,505,00<br>0 | 1,821,634,064.<br>65 |
| 160213 | 16国开13 | 2022-01-05 | 98.44      | 4,348,000      | 428,017,558.12       |

|        |        |            |       |            |                  |
|--------|--------|------------|-------|------------|------------------|
| 160213 | 16国开13 | 2022-01-07 | 98.44 | 2,174,000  | 214,008,779.06   |
| 160213 | 16国开13 | 2022-01-12 | 98.44 | 1,087,000  | 107,004,389.53   |
| 160310 | 16进出10 | 2022-01-06 | 98.87 | 7,862,000  | 777,281,433.25   |
| 160310 | 16进出10 | 2022-01-10 | 98.87 | 8,696,000  | 859,735,352.78   |
| 160310 | 16进出10 | 2022-01-13 | 98.87 | 4,348,000  | 429,867,676.39   |
| 合计     |        |            |       | 47,020,000 | 4,637,549,253.78 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、同业存单、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)。基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。

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；以董事会下属风险与合规管理委员会对公司经营管理和基金运作中的合法合规性实行全面监督的第四道防线。风险与合规管理委员会对公司经营和基金运作中的风险进行严格的合规检查和风险控制评估并审议公司风险管理工作报告。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

#### 7.4.13.2 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人兴业银行，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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

##### 7.4.13.2.4 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<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|
| AAA    | -                  |
| AAA以下  | -                  |

|     |                   |
|-----|-------------------|
| 未评级 | 10,251,182,010.43 |
| 合计  | 10,251,182,010.43 |

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

#### 7.4.13.3 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。本基金的债券投资采用买入持有至到期策略，流动性风险主要来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内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，有效保障基金持有人利益。

于2021年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有4,342,416,172.76元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金无主动投资流动性受限资产。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金对投资组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金的基金管理人主要通过合理配置投资组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。本基金主要投资于固定利率类的固定收益品种，因此很大程度上独立于市场利率变化。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021年1<br>2月31日 | 1年以内         | 1-5年              | 5年以上 | 不计息            | 合计                |
|------------------------|--------------|-------------------|------|----------------|-------------------|
| 资产                     |              |                   |      |                |                   |
| 银行存款                   | 1,511,829.47 | -                 | -    | -              | 1,511,829.47      |
| 其他资产                   | -            | 10,251,182,010.43 | -    | -              | 10,251,182,010.43 |
| 应收利                    | -            | -                 | -    | 111,252,824.76 | 111,252,824.76    |



|           |                   |                   |   |                |                   |
|-----------|-------------------|-------------------|---|----------------|-------------------|
| 息         |                   |                   |   |                |                   |
| 资产总计      | 1,511,829.47      | 10,251,182,010.43 | - | 111,252,824.76 | 10,363,946,664.66 |
| 负债        |                   |                   |   |                |                   |
| 卖出回购金融资产款 | 4,342,416,172.76  | -                 | - | -              | 4,342,416,172.76  |
| 应付管理人报酬   | -                 | -                 | - | 767,864.82     | 767,864.82        |
| 应付托管费     | -                 | -                 | - | 255,954.94     | 255,954.94        |
| 应付交易费用    | -                 | -                 | - | 130,873.22     | 130,873.22        |
| 应付利息      | -                 | -                 | - | 2,149,496.17   | 2,149,496.17      |
| 其他负债      | -                 | -                 | - | 220,000.00     | 220,000.00        |
| 负债总计      | 4,342,416,172.76  | -                 | - | 3,524,189.15   | 4,345,940,361.91  |
| 利率敏感度缺口   | -4,340,904,343.29 | 10,251,182,010.43 | - | 107,728,635.61 | 6,018,006,302.75  |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31日，本基金持有至到期的债券投资均为固定利率类的债券品种，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.14 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

于2021年12月31日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021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、持有至到期投资和其他金融负债等。

于2021年12月31日，本基金持有的持有至到期投资账面价值为人民币10,251,182,010.43元，公允价值为人民币10,504,249,600.00元。除持有至到期投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

持有至到期投资按如下原则确定公允价值：(i) 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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。(ii) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。(iii) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》的有关规定，本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值；本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。于2021年12月31日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初所有者权益,2021年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外,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  | 权益投资              | -                 | -            |
|    | 其中:股票             | -                 | -            |
| 2  | 基金投资              | -                 | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 10,251,182,010.43 | 98.91        |
|    | 其中:债券             | 10,251,182,010.43 | 98.91        |
|    | 资产支持证券            | -                 | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -                 | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                 | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                 | -            |
|    | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,511,829.47      | 0.01         |
| 8  | 其他各项资产            | 111,252,824.76    | 1.07         |
| 9  | 合计                | 10,363,946,664.66 | 100.00       |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

根据基金合同约定，本基金不参与股票交易。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

根据基金合同约定，本基金不参与股票交易。

## 8.3 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

根据基金合同约定，本基金不参与股票交易。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

根据基金合同约定，本基金不参与股票交易。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

根据基金合同约定，本基金不参与股票交易。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

根据基金合同约定，本基金不参与股票交易。

## 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      | 公允价值              | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                 | -            |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 10,251,182,010.43 | 170.34       |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,251,182,010.43 | 170.34       |
| 4  | 企业债券      | -                 | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -                 | -            |
| 6  | 中期票据      | -                 | -            |
| 7  | 可转债(可交换债) | -                 | -            |
| 8  | 同业存单      | -                 | -            |

|    |    |                   |        |
|----|----|-------------------|--------|
| 9  | 其他 | -                 | -      |
| 10 | 合计 | 10,251,182,010.43 | 170.34 |

### 8.6 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  | 160310 | 16进出10 | 53,980,000 | 5,336,765,678.81 | 88.68        |
| 2  | 160213 | 16国开13 | 44,000,000 | 4,331,364,433.64 | 71.97        |
| 3  | 190408 | 19农发08 | 3,200,000  | 323,302,462.32   | 5.37         |
| 4  | 210408 | 21农发08 | 2,600,000  | 259,749,435.66   | 4.32         |

### 8.7 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

根据基金合同约定，本基金不参与资产支持证券投资。

### 8.8 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

根据基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

### 8.9 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

根据基金合同约定，本基金不参与权证投资。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同约定，本基金不参与股指期货投资。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同约定，本基金不参与国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 通过查阅中国证监会、中国银保监会网站公开目录“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除16进出10（160310.IB）的发行主体中国进出口银行外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。2021年7月13日，中国进出口银行因违规投资企业股权等多项违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会出具行政处罚（银保监罚决字[2021]31号），罚没7345.6万元。对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

8.12.2 根据基金合同约定，本基金不参与股票投资。

### 8.12.3 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   | -              |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 111,252,824.76 |
| 5  | 应收申购款   | -              |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 111,252,824.76 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

根据基金合同约定，本基金不参与可转换债券投资。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

根据基金合同约定，本基金不参与股票投资。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

| 持有人户数<br>(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 |
| 213          | 28,164,426.53 | 5,998,990,486.11 | 100.00% | 32,365.12 | 0.00%  |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 1,339.43  | 0.00%    |

### 9.3 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                           | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金              | 0~10              |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2021年03月16日)基金份额总额 | 5,999,022,824.19 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额      | 27.04            |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额    | -                |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额     | -                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 5,999,022,851.23 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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。

### 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。

### 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）。本报告期内应支付审计费用12万元。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、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 |    |
| 安信证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华泰证券   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东方财富证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |



|          |   |   |   |   |   |   |
|----------|---|---|---|---|---|---|
| 东兴<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华福<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 开源<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江<br>证券 | 3 | - | - | - | - | - |

注1：本基金自基金合同生效日起，截止本报告期期末本基金已有31个交易单元，分别为兴业证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，华福证券有限责任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，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、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2个上交所交易单元及1个深交所交易单元，广发证券有限公司上交所及深交所交易单元，方正证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，华创

证券有限责任公司上交所及深交所交易单元，华泰证券股份有限公司上交所交易单元，安信证券股份有限公司深交所交易单元，中国银河证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，开源证券股份有限公司上交所及深交所交易单元和东方财富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
- (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

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 |              | 基金交易 |              |
|--------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|        | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 安信证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华泰证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东方财富证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 东兴证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 方正证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |

|      |   |   |                   |         |   |   |   |   |
|------|---|---|-------------------|---------|---|---|---|---|
| 广发证券 | - | - | -                 | -       | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | -                 | -       | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | -                 | -       | - | - | - | - |
| 华福证券 | - | - | -                 | -       | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | -                 | -       | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | -                 | -       | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | 12,515,845,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | -                 | -       | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | -                 | -       | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | -                 | -       | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | -                 | -       | - | - | - | - |

### 11.8 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  | 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要        | 证监会规定媒介 | 2021-02-19 |
| 2  | 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金托管协议            | 证监会规定媒介 | 2021-02-19 |
| 3  | 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书           | 证监会规定媒介 | 2021-02-19 |
| 4  | 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同            | 证监会规定媒介 | 2021-02-19 |
| 5  | 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告 | 证监会规定媒介 | 2021-02-19 |
| 6  | 圆信永丰瑞丰66个月定期开                          | 证监会规定媒介 | 2021-02-19 |

|    |   |         |            |
|----|---|---------|------------|
|    | 放债券型证券投资基金基金份额发售公告                              |         |            |
| 7  | 圆信永丰基金管理有限公司关于圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金提前结束募集期的公告 | 证监会规定媒介 | 2021-03-16 |
| 8  | 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告                 | 证监会规定媒介 | 2021-03-17 |
| 9  | 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金2021年第二季度报告              | 证监会规定媒介 | 2021-07-21 |
| 10 | 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金2021年中期报告                | 证监会规定媒介 | 2021-08-31 |
| 11 | 圆信永丰基金管理有限公司关于电子直销交易暂停受理工商银行直连支付渠道开户业务的公告       | 证监会规定媒介 | 2021-09-04 |
| 12 | 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金分红公告                     | 证监会规定媒介 | 2021-09-11 |
| 13 | 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金2021年第三季度报告              | 证监会规定媒介 | 2021-10-27 |
| 14 | 圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金分红公告                     | 证监会规定媒介 | 2021-12-08 |

## § 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 | 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              | 持有基金份额比 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额       | 持有份额 | 份额占比 |
|    |                |         |      |      |            |      |      |

| 者类别   | 号 | 例达到或者超过 20%的时间区间       |      |                  |      |                  |        |
|---|---|------------------------|------|------------------|------|------------------|--------|
| 机构  | 1 | 20210316-202111<br>231 | 0.00 | 2,499,999,000.00 | 0.00 | 2,499,999,000.00 | 41.67% |
|   | 2 | 20210316-202111<br>231 | 0.00 | 1,199,999,000.00 | 0.00 | 1,199,999,000.00 | 20.00% |
| 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。 |   |                        |      |                  |      |                  |        |

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《圆信永丰瑞丰66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《圆信永丰瑞丰66个月定期开放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。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 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>

圆信永丰基金管理有限公司

二〇二二年三月三十一日