

# 圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 8 月 30 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	圆信永丰优享生活
基金主代码	004958
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 8 月 30 日
基金管理人	圆信永丰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,019,884,870.55 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注国家健康生活产品发展过程中带来的投资机会，综合运用多种投资策略，精选健康生活产业及相关产业中的优质企业进行投资，在充分控制风险的前提下，灵活配置股票、债券等大类资产，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上，自上而下调整基金大类资产配置和股票行业配置策略，确定债券组合久期和债券类别配置；在严谨深入的股票和债券研究分析基础上，自下而上精选个券。其中，本基金股票投资重点关注意于有利引领和提升居民生活水平的上市公司，把握经济增长过程中居民需求升级蕴含的投资机会。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65% + 上证国债指数收益率×35%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		圆信永丰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕富强	郭明

	联系电话	021-60366000	010-66105799
	电子邮箱	service@gtsfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006070088	95588
传真		021-60366006	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金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

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 8 月 30 日 (基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日	2016 年	2015 年
本期已实现收益	29,142,112.12	-	-
本期利润	47,791,266.78	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0400	-	-
本期基金份额净值增长率	3.73%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0262	-	-
期末基金资产净值	1,057,899,419.73	-	-
期末基金份额净值	1.0373	-	-

注 1：本期指 2017 年 8 月 30 日至 2017 年 12 月 31 日，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（例如，申购费、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

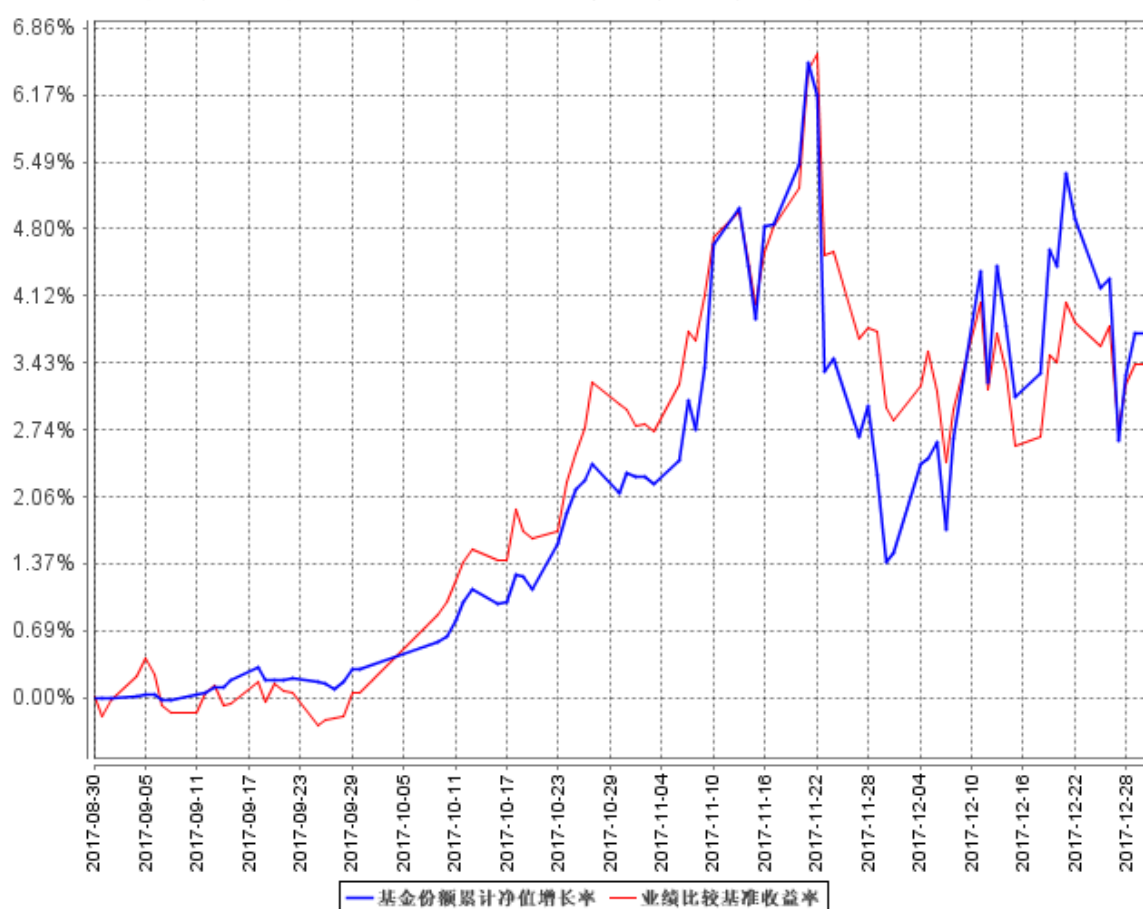
### 3.2 基金净值表现

#### 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	3.42%	0.70%	3.34%	0.52%	0.08%	0.18%
自基金合同 生效起至今	3.73%	0.60%	3.41%	0.45%	0.32%	0.15%

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

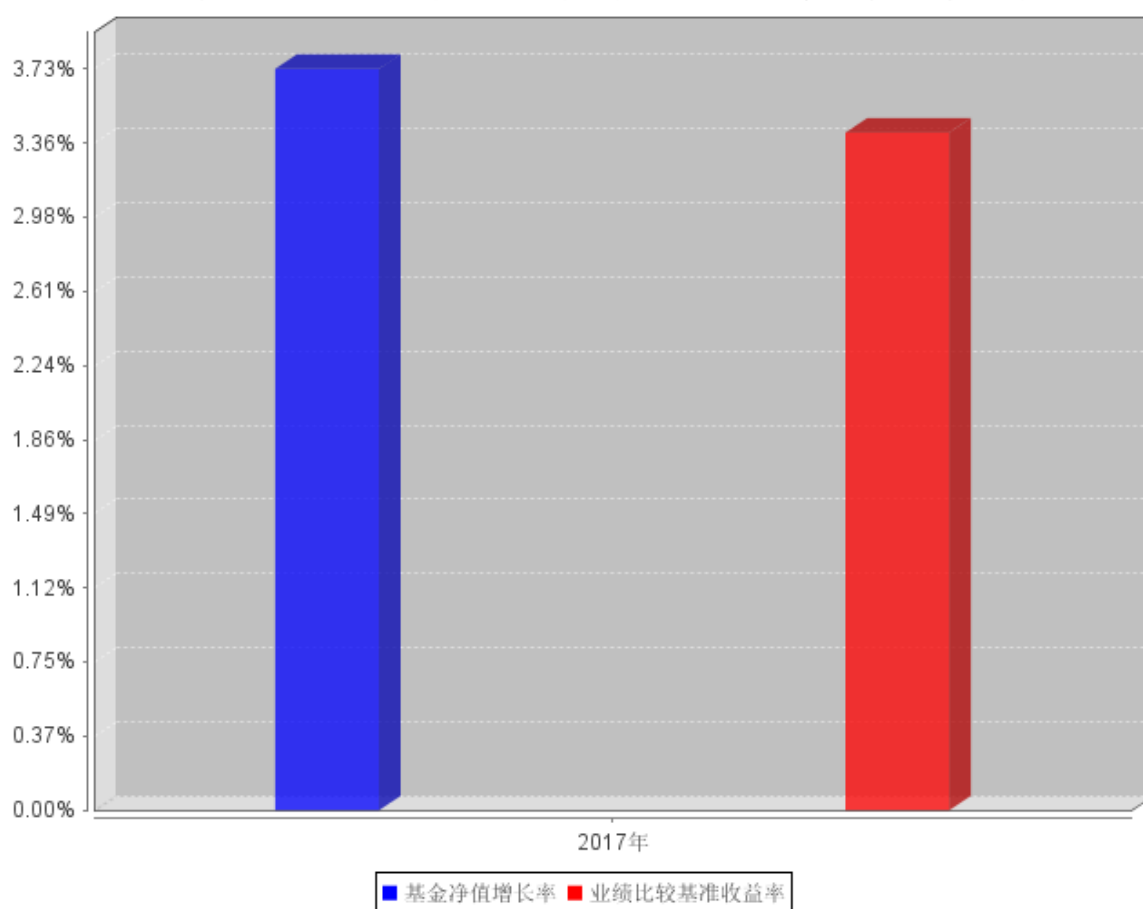
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：自基金合同生效后，截止报告期末，本基金成立不满一年，截止报告期末尚处于建仓期。

### 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

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

注：截止 2017 年末，本基金未进行利润分配。

## § 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		
范妍	本基金基金经理	2017 年 8 月 30 日	—	9 年	复旦大学管理学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设权益投资部总监。历任兴业证券研究中心助理策略分析师、安信证券研究中心高级策略分析师、工银瑞信基金策略研究员、圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设权益投资部副总监。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格证。
肖世源	本基金基金经理	2017 年 9 月 14 日	—	6 年	复旦大学中西医结合临床硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设权益投资部基金经理。历任上海合懿投资管理合伙企业（有限合伙）投研部研究员，上海呈瑞投资管理有限公司投研部研究员，圆信永丰基金管理有限公司研究部研究员。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格证。
李家亮	本基金基金经理	2017 年 8 月 30 日	2017 年 9 月 6 日	6 年	上海交通大学工商管理硕士，历任圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设权益投资部基金经理、上海杰运投资管理有限公司研究部研究员、邻智科技网络有限公司研究部研究员、圆信永丰基金管理有限公司研究

					部研究员。
--	--	--	--	--	-------

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

处于建仓期，以累积安全垫为主。经济增长目标由追求杠杆推动的有速度的增长，转向有质量、有效率的的增长，在这一背景越来越多的行业转向了低速增长，行业内部的分化趋势日益加大。同时，货币政策偏向中性，利率水平偏高，在这样的背景下股票的估值存在压力，股票配置上选择盈利增长稳定能够用盈利增长对冲估值下滑的个股，行业分布较为均匀。周期性行业的选择同样以行业的成长性为基础，选择供给格局改善的航空行业和竞争力优化的 PTA 产业链。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金的份额净值为 1.0373 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.73%，业绩比较基准收益率为 3.41%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年全年，经济平稳下行，固定资产投资略低于我们之前的预期，消费增长下半年开始放缓，在 2018 年年初，消费下滑仍然没有结束的迹象。另外一方面，金融去杠杆的背景下，社融增速放缓，贷款利率上行的情况到今年一季度末可能仍然没有结束。

我们密切关注利率水平的整体情况，如果利率水平维持高位，那么行业配置上，我们规避由估值上升推动的行业以及高杠杆的行业，偏向盈利增长驱动的行业，以期待盈利增长能够对冲估值下行的压力。周期类行业中，我们观察到部分行业的产能开始周期，供需情况可能逆转，因此选择供给约束强而需求仍有双位数增长的行业，例如保险和航空。

如果利率开始下行，我们将适度提升整体的权益部分仓位。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017 年，证监会系统着力推进依法监管、从严监管、全面监管的理念，中国证监会领导提出了夯实发展基础、统一监管标准、推动资管行业持续健康发展的期望。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，基金管理人进一步加大了针对投资风险、流动性风险的监督，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，强化事后稽核力度，提高工作水平。做好有重点的专项审计，针对性的发现内控薄弱环节。

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，充分利用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、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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 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的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金的管理人——圆信永丰基金管理有限公司在圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人依法对圆信永丰基金管理有限公司编制和披露的圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 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 20375 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	圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资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，公允反映了圆信永丰优享生活 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 8 月 30 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优享生活，并履行了职业道德方面的其他责任。
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	圆信永丰优享生活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。 在编制财务报表时，管理层负责评估圆信永丰优享生活的持续经营能力，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圆信永丰优享生活、终止运营或别无其他现实的选择。 圆信永丰优享生活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圆信永丰优享生活的财务报告过程。
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。 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

	<p>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，就可能导致对圆信永丰优享生活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优享生活不能持续经营。</p> <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。</p> <p>我们与圆信永丰优享生活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。</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	单峰	陈迺迺
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优享生活灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“圆信永丰优享生活”)的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年 8 月 30 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：圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金

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
资 产：			
银行存款		6,697,949.19	—
结算备付金		32,710,048.59	—
存出保证金		283,249.57	—
交易性金融资产		921,442,858.42	—
其中：股票投资		866,221,714.22	—

基金投资		-	-
债券投资		55,221,144.20	-
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		80,060,210.09	-
应收证券清算款		28,114,328.24	-
应收利息		1,098,594.84	-
应收股利		-	-
应收申购款		369,108.23	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,070,776,347.17	-
<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		-	-
应付证券清算款		5,931,680.17	-
应付赎回款		3,959,996.59	-
应付管理人报酬		1,396,250.19	-
应付托管费		186,166.66	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,293,081.68	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		109,752.15	-
负债合计		12,876,927.44	-
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		1,019,884,870.55	-
未分配利润		38,014,549.18	-
所有者权益合计		1,057,899,419.73	-
负债和所有者权益总计		1,070,776,347.17	-

注: 1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.0373 元, 基金份额总额 1,019,884,870.55 份。

注: 2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 8 月 30 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：圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 8 月 30 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 8 月 30 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
<b>一、收入</b>		57,186,921.21	-
1. 利息收入		9,206,606.18	-
其中：存款利息收入		4,770,499.84	-
债券利息收入		626,032.61	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,810,073.73	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		28,257,715.68	-
其中：股票投资收益		28,082,658.60	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		47,064.96	-
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		127,992.12	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		18,649,154.66	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		1,073,444.69	-
<b>减：二、费用</b>		9,395,654.43	-
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	6,174,722.14	-
2. 托管费	7.4.8.2.2	823,296.26	-
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		2,295,999.43	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		101,636.60	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		47,791,266.78	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		47,791,266.78	-



### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 8 月 30 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 8 月 30 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）	1,276,188,248.02	-	1,276,188,248.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	47,791,266.78	47,791,266.78
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）	-256,303,377.47	-9,776,717.60	-266,080,095.07
其中：1. 基金申购款	50,951,568.88	1,838,759.18	52,790,328.06
2. 基金赎回款	-307,254,946.35	-11,615,476.78	-318,870,423.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,019,884,870.55	38,014,549.18	1,057,899,419.73
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

圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]第 1059 号《关于准予圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由圆信永丰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,275,938,076.72 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 783 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 8 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,276,188,248.02 份基金份额，其中认购资金利息折合 250,171.30 份基金份额。本基金的基金管理人为圆信永丰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含主板、创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、中小企业私募债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%。投资于优享生活主题相关的证券比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不

低于基金资产净值的 5%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×35%。

#### 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》、《圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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 2017 年 8 月 30 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 8 月 30 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

根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自 2017 年 12 月 29 日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中央国债登记结算有限责任公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

##### 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[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) 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，股票的股息、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。

### 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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
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

本基金本报告期内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 2017 年 8 月 30 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
当期发生的基金应支付的管理费	6,174,722.14	-
其中：支付销售机构的客户维护费	3,323,682.62	-

注：支付基金管理人圆信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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 X 1.50% / 当年天数。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 8 月 30 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
当期发生的基金应支付的托管费	823,296.26	-

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 X 0.20% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

#### 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

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

注：本基金报告期末及上年度可比期间内无基金管理人运用固有基金投资本基金的情况。

##### 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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 8 月 30 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
中国工商银行	6,697,949.19	255,423.42	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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：本基金本报告期内及上年度可比期间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

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

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-

603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未 上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未 上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股未 上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

#### 7.4.9.2 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
300730	科创信息	2017 年 12 月 25 日	重大 事项	41.55	2018 年 1 月 2 日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	重大 事项	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 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一层次的余额为 866,073,206.02 元，属于第二层次的余额为 55,369,652.40 元，无属于第三层次的余额。

(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 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	权益投资	866,221,714.22	80.90
	其中：股票	866,221,714.22	80.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	55,221,144.20	5.16
	其中：债券	55,221,144.20	5.16
	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	80,060,210.09	7.48
	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	39,407,997.78	3.68
8	其他各项资产	29,865,280.88	2.79
9	合计	1,070,776,347.17	100.00

### 8.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	22,427,261.28	2.12
B	采矿业	10,827,000.00	1.02
C	制造业	484,223,606.01	45.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,680,500.40	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	26,583,489.78	2.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	92,573,229.80	8.75
J	金融业	156,529,702.92	14.80
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	140,023.20	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	27,038,971.38	2.56
R	文化、体育和娱乐业	29,181,786.25	2.76
S	综合	-	-
	合计	866,221,714.22	81.88

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	805,297	56,354,684.06	5.33
2	600406	国电南瑞	3,000,077	54,841,407.56	5.18
3	601601	中国太保	1,192,933	49,411,284.86	4.67
4	000858	五粮液	550,000	43,934,000.00	4.15
5	000651	格力电器	1,000,004	43,700,174.80	4.13
6	600887	伊利股份	1,150,000	37,018,500.00	3.50

7	002236	大华股份	1,540,011	35,558,853.99	3.36
8	603899	晨光文具	1,283,014	31,639,125.24	2.99
9	000513	丽珠集团	449,903	29,896,054.35	2.83
10	002831	裕同科技	500,300	27,956,764.00	2.64

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

## 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

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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	57,418,035.71	5.43
2	601601	中国太保	53,865,544.45	5.09
3	000513	丽珠集团	52,987,643.22	5.01
4	600406	国电南瑞	52,263,826.51	4.94
5	600029	南方航空	49,886,824.14	4.72
6	601318	中国平安	45,793,899.15	4.33
7	000858	五粮液	43,100,467.99	4.07
8	000651	格力电器	41,004,692.13	3.88
9	600038	中直股份	39,958,173.96	3.78
10	002236	大华股份	39,833,269.78	3.77
11	601939	建设银行	39,267,427.40	3.71
12	300408	三环集团	37,311,510.28	3.53
13	002572	索菲亚	35,302,705.32	3.34
14	002831	裕同科技	35,057,411.99	3.31
15	300244	迪安诊断	32,950,437.28	3.11
16	603899	晨光文具	31,782,238.86	3.00
17	601688	华泰证券	28,041,050.66	2.65
18	300115	长盈精密	27,483,081.46	2.60
19	002202	金风科技	26,227,255.50	2.48
20	603589	口子窖	25,339,651.50	2.40
21	002179	中航光电	25,288,658.23	2.39
22	002624	完美世界	24,751,208.03	2.34
23	002343	慈文传媒	24,242,783.01	2.29

24	300059	东方财富	24,175,658.00	2.29
25	000001	平安银行	22,710,075.26	2.15
26	300232	洲明科技	22,577,226.97	2.13
27	600519	贵州茅台	22,326,680.30	2.11

#### 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

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601939	建设银行	39,695,097.71	3.75
2	300408	三环集团	36,135,794.77	3.42
3	002202	金风科技	32,936,326.06	3.11
4	600029	南方航空	31,385,404.33	2.97
5	000513	丽珠集团	27,653,295.45	2.61
6	600887	伊利股份	25,420,771.99	2.40
7	600036	招商银行	24,657,517.00	2.33
8	300059	东方财富	23,902,231.00	2.26
9	300115	长盈精密	23,796,773.10	2.25
10	600038	中直股份	18,432,836.30	1.74
11	000538	云南白药	17,190,565.45	1.62
12	600803	新奥股份	16,449,916.67	1.55
13	600048	保利地产	15,469,461.00	1.46
14	002572	索菲亚	13,406,073.76	1.27
15	600643	爱建集团	13,364,354.95	1.26
16	002222	福晶科技	12,247,262.00	1.16
17	000858	五粮液	11,000,128.08	1.04
18	600519	贵州茅台	10,658,198.60	1.01
19	300054	鼎龙股份	10,261,004.60	0.97
20	600383	金地集团	10,217,860.50	0.97

#### 8.4.3 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	1,349,282,379.46
卖出股票收入（成交）总额	529,961,195.10

## 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	25,250,144.20	2.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,971,000.00	2.83
	其中：政策性金融债	29,971,000.00	2.83
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	55,221,144.20	5.22

## 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	080214	08 国开 14	200,000	20,106,000.00	1.90
2	019563	17 国债 09	145,400	14,518,190.00	1.37
3	019557	17 国债 03	107,470	10,731,954.20	1.01
4	150317	15 进出 17	100,000	9,865,000.00	0.93

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

注：根据基金合同规定，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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

注：根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细



注：根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

注：根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

通过查阅中国证监会网站公开目录“行政处罚决定”及查阅相关发行主体的公司公告，在基

金管理人知悉的范围内，报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

本基金投资前十名股票中，不存在投资于超过基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 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	283,249.57
2	应收证券清算款	28,114,328.24
3	应收股利	—
4	应收利息	1,098,594.84
5	应收申购款	369,108.23
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	29,865,280.88

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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 (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
11,974	85,174.95	13,337,363.91	1.31%	1,006,547,506.64	98.69%

### 9.3 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	1,172,196.67	0.1149%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

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 100 万份以上。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 8 月 30 日）基金份额总额	1,276,188,248.02
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	50,951,568.88
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	307,254,946.35
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	1,019,884,870.55

## § 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；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 万元。目前事务所已提供审计服务的连续年限：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

报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 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	
中金公司	2	92,690,856.30	4.94%	86,322.71	5.40%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	83,622,379.26	4.45%	77,877.30	4.87%	-
中信建投	2	161,017,669.16	8.58%	149,955.96	9.38%	-
天风证券	2	134,598,363.58	7.17%	98,431.84	6.16%	-
东方证券	2	455,599,301.40	24.27%	333,180.01	20.84%	-
华泰证券	1	157,341,490.62	8.38%	115,063.85	7.20%	-
兴业证券	2	159,171,609.54	8.48%	148,236.73	9.27%	-
申万宏源证券	2	117,142,185.67	6.24%	109,093.82	6.82%	-
海通证券	2	88,265,267.66	4.70%	82,201.58	5.14%	-

东吴证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	428,113,681.18	22.80%	398,704.16	24.93%	-

注：1. 本报告期内基金新增 29 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，海通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，中国国际金融有限公司上交所及深交所交易单元，招商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、东方证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，申万宏源股份有限公司上交所及深交所交易单元，华泰证券股份有限公司深交所交易单元，平安证券有限责任公司上交所及深交所交易单元，东吴证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，天风证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，国金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
中金公司	-	-	590,000,000.00	3.31%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	1,230,000,000.00	6.90%	-	-
中信建投	-	-	1,500,000,000.00	8.42%	-	-
天风证券	391,344.96	0.85%	3,170,000,000.00	17.79%	-	-
东方证券	-	-	2,040,000,000.00	11.45%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	45,615,670.80	99.15%	3,580,000,000.00	20.09%	-	-
申万宏源证券	-	-	1,130,000,000.00	6.34%	-	-
海通证券	-	-	466,000,000.00	2.61%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	4,115,000,000.00	23.09%	-	-

## § 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

注：报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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