

圆信永丰优加生活股票型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 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：2017 年 3 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 2017 年 3 月 24 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 2016 年 1 月 1 日起至 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.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告	39
8.1 期末基金资产组合情况.....	39
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46

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	46
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	46
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
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的情况	47
§10 开放式基金份额变动	48
§11 重大事件揭示	48
11.1 基金份额持有人大会决议	48
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	49
11.8 其他重大事件	50
§12 影响投资者决策的其他重要信息	50
§13 备查文件目录	50
13.1 备查文件目录	50
13.2 存放地点	51
13.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	圆信永丰优加生活股票型证券投资基金
基金简称	圆信永丰优加生活
基金主代码	001736
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 10 月 28 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	495,271,424.00 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于有利于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，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	基于对优加生活上市公司的界定，本基金主要采取“自下而上”的选股策略，基于对上市公司成长性和估值水平的综合考量，使用定性与定量相结合的方法精选股票进行投资。在行业配置的基础上，本基金管理人将采取“自下而上”的研究方法，充分发挥投研团队的主动选股能力，紧密围绕优加生活投资主题，从上市公司的基本面研究出发，挖掘出符合中国经济转型、具有爆发式增长机会、有利于改善人类生活质量、持续成长能力的优质企业。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，具有较高预期风险和较高预期收益特征。

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
注册地址		中国（福建）自由贸易试验区厦门片区（保税港区）海景南二路 45 号 4 楼 402 单元之 175	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 19 楼	上海市江宁路 168 号兴业大厦 20 楼

邮政编码	200122	200041
法定代表人	洪文瑾	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtsfund.com.cn
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(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	圆信永丰基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 19 楼

§ 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	2016 年	2015 年 10 月 28 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	2014 年
本期已实现收益	61,510,401.46	6,257,321.04	-
本期利润	65,653,890.74	14,618,345.19	-
加权平均基金份额本期利润	0.1573	0.0300	-
本期加权平均净值利润率	13.80%	2.95%	-
本期基金份额净值增长率	17.96%	3.00%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	84,576,814.47	6,257,321.04	-
期末可供分配基金份额利润	0.1708	0.0129	-
期末基金资产净值	601,665,454.49	501,170,145.78	-
期末基金份额净值	1.215	1.030	-
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	21.50%	3.00%	-

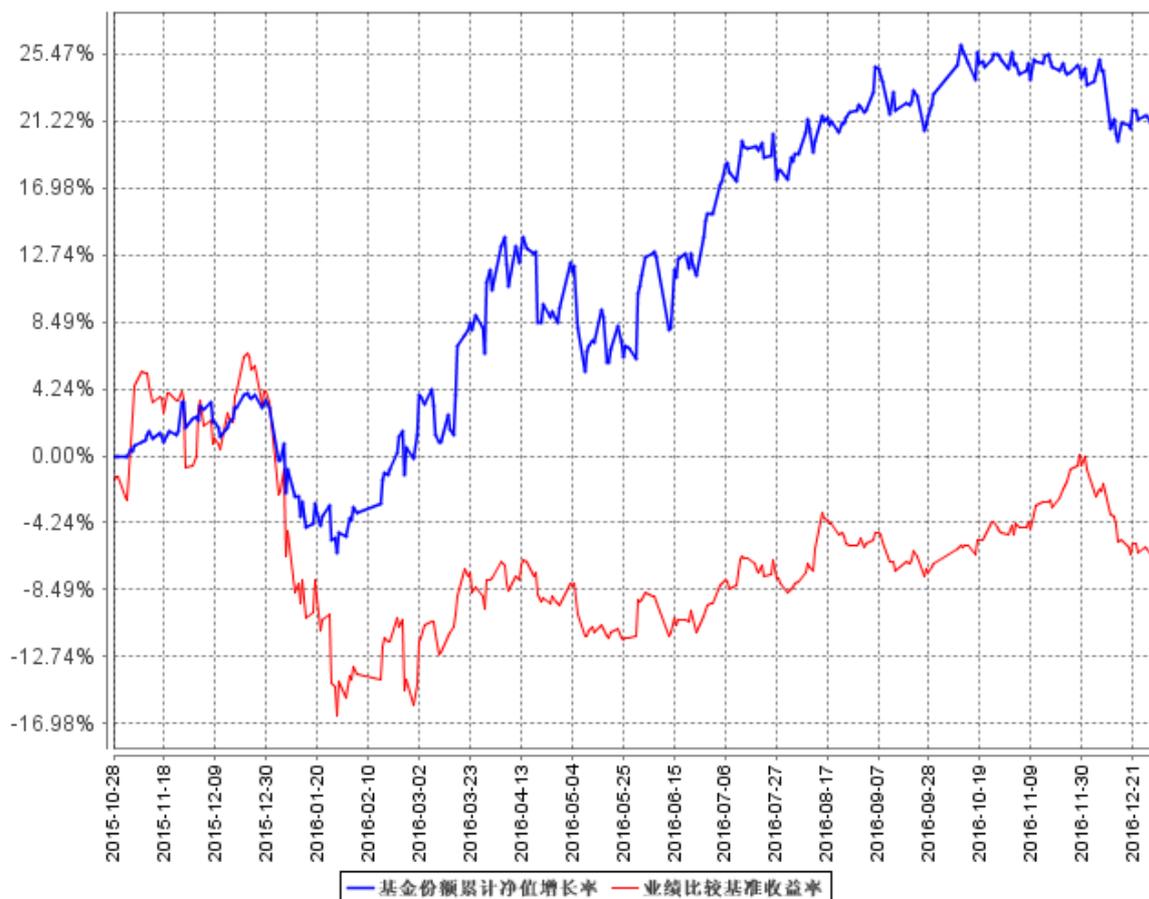
3.2 基金净值表现

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	-1.14%	0.65%	0.94%	0.58%	-2.08%	0.07%
过去六个月	5.38%	0.70%	3.70%	0.61%	1.68%	0.09%
过去一年	17.96%	1.13%	-9.08%	1.12%	27.04%	0.01%
自基金合同生效起至今	21.50%	1.05%	-6.01%	1.15%	27.51%	-0.10%

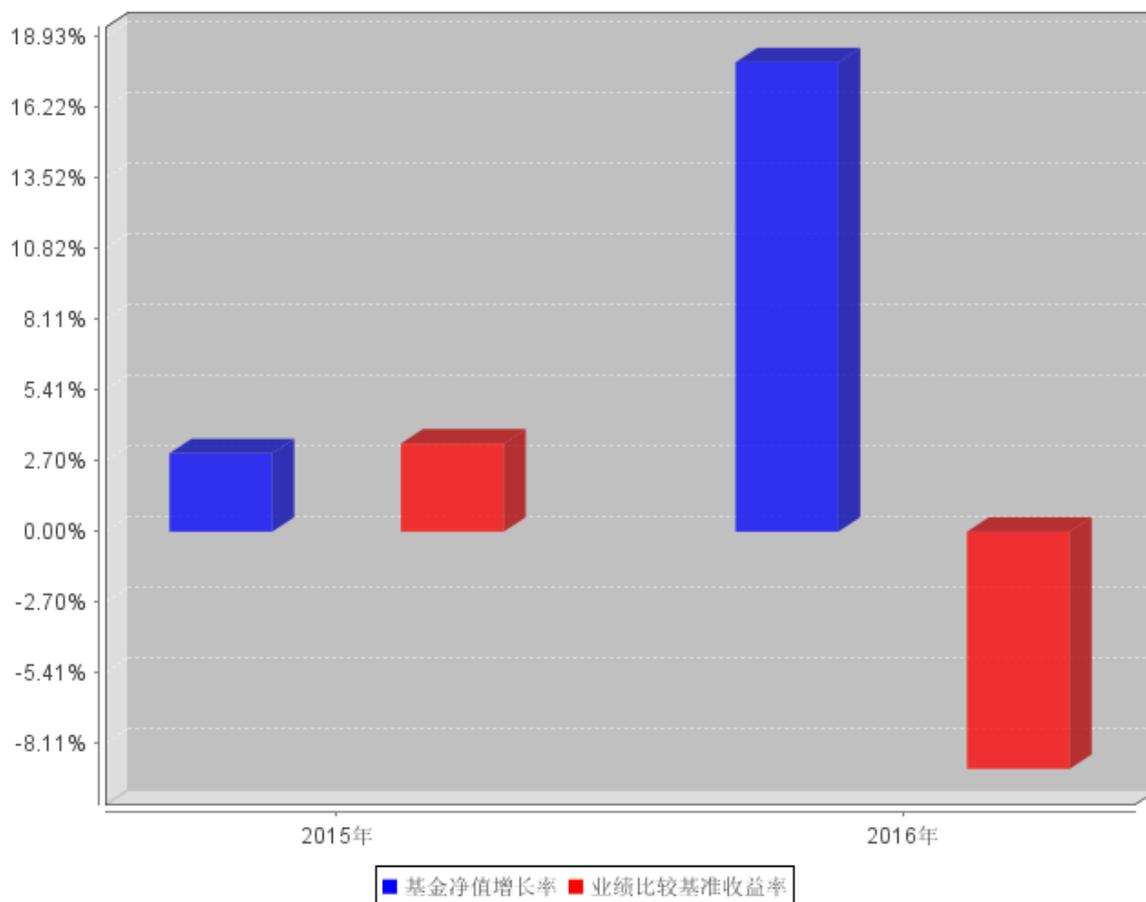
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：截止 2016 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 2016 年 12 月 31 日，公司旗下共管理六只开放式基金产品，包括一只股票型基金、一只

混合型基金和四只债券型基金。

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		
洪流	本基金基金经理	2015年10月28日	-	18年	上海财经大学金融学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司首席投资官。历任新疆金新信托证券管理总部信息研究部经理，德恒证券信息研究部副总经理，德恒证券经纪业务管理总部副总经理，兴业证券股份有限公司理财服务中心首席理财分析师，兴业证券股份有限公司上海资产管理分公司副总监。
范妍	本基金基金经理	2015年10月28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。

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、《圆信永丰优加生活股票型证券投资基金基金合同》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对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

2016 年一季度，我们在组合中加入了一些供应收缩、价格上涨的行业，例如养殖、维生素和造纸；二季度延续了一季度的思路，继续配置供应收缩的周期性行业，成长股相对看好电子发票、手游、电子化学品、OLED 等细分子行业。此外，景气度较高的白酒和定制家具行业也配置了一定的比例。三、四季度，自下而上看，很多个股的风险收益比再上升，我们兑现了部分前期涨幅较大的股票的收益，置换为 2016 年几乎没有表现的一些行业。但是，由于年末货币政策由稳健变为中性，新股发行的速度也有所上升，成长股的估值出现了快速调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值 1.215 元（累计净值 1.215 元）。报告期内本基金净值增长率为 17.96%，高于业绩比较基准 27.04 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年大宗商品涨价是贯穿全年的主题，2017 年我们认为需要仔细甄别，区别对待。近期跟踪的国内终端需求有转弱的迹象，黑色产业链表现出供需两弱的特征。随着企业盈利好转，部分行业供应增速开始加快，库存上升，这也可能打破供需平衡，我们将密切关注这一趋势。此外，能源、食品、劳动力成本可能是 2017 年需要关注的重点，CPI 一旦超出 3%，我们将减仓并调整整个组合的风险暴露比例。

配置上我们目前偏向以下几类：一类是今年滞涨的周期性品种，例如石油相关产业链和农产品相关产业链；一类是政策类行业，例如军工、基建和铁路设备；一类是成长股里的结构性行情，如旅游、传媒、医药流通、物流自动化等；最后一类是投资周期相关的机械板块。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 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。

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

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(2017)第 20215 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	圆信永丰优加生活股票型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的圆信永丰优加生活股票型证券投资基金(以下简称“圆信永丰优加生活股票型基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度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。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是圆信永丰优加生活股票型基金的基金管理人圆信永丰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和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财务报表,并使其实现公允反映;(2)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。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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>	
审计意见段	我们认为,上述圆信永丰优加生活股票型基金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,公允反映了圆信永丰优加生活股票型基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	单峰	陈迺迤
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)	
会计师事务所的地址	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2017 年 3 月 17 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：圆信永丰优加生活股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	25,026,258.40	267,506,817.95
结算备付金		2,973,517.76	3,663,099.17
存出保证金		253,375.51	87,998.01
交易性金融资产	7.4.7.2	526,536,308.26	235,754,255.69
其中：股票投资		503,534,308.26	170,628,572.29
基金投资		-	-
债券投资		23,002,000.00	65,125,683.40
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	50,000,000.00	-
应收证券清算款		26,111.12	-
应收利息	7.4.7.5	455,832.66	568,782.60
应收股利		-	-
应收申购款		1,695,018.40	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		606,966,422.11	507,580,953.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	-
应付证券清算款		2,685,395.82	5,111,624.25
应付赎回款		1,353,356.84	-
应付管理人报酬		749,218.98	637,121.17
应付托管费		124,869.88	106,186.85
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	247,148.14	505,875.37
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	140,977.96	50,000.00
负债合计		5,300,967.62	6,410,807.64
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	495,271,424.00	486,551,800.59
未分配利润	7.4.7.10	106,394,030.49	14,618,345.19
所有者权益合计		601,665,454.49	501,170,145.78
负债和所有者权益总计		606,966,422.11	507,580,953.42

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.215 元，基金份额总额 495,271,424.00 份。

7.2 利润表

会计主体：圆信永丰优加生活股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 10 月 28 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		76,508,664.90	17,014,217.22
1. 利息收入		2,295,788.48	1,164,403.36
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,209,023.81	470,020.34
债券利息收入		501,913.37	169,741.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		584,851.30	524,641.08
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		68,507,599.01	7,488,789.71
其中：股票投资收益	7.4.7.12	62,636,986.65	5,972,727.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,447,936.88	1,516,062.54
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,422,675.48	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,143,489.28	8,361,024.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,561,788.13	-
减：二、费用		10,854,774.16	2,395,872.03
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,130,918.18	1,303,902.83
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,188,486.50	217,317.13

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,362,816.42	777,915.53
5. 利息支出		-	6,116.54
其中：卖出回购金融资产支出		-	6,116.54
6. 其他费用	7.4.7.20	172,553.06	90,620.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		65,653,890.74	14,618,345.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		65,653,890.74	14,618,345.19

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：圆信永丰优加生活股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	486,551,800.59	14,618,345.19	501,170,145.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	65,653,890.74	65,653,890.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	8,719,623.41	26,121,794.56	34,841,417.97
其中：1. 基金申购款	531,390,338.18	90,350,362.41	621,740,700.59
2. 基金赎回款	-522,670,714.77	-64,228,567.85	-586,899,282.62
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）	495,271,424.00	106,394,030.49	601,665,454.49
项目	上年度可比期间 2015 年 10 月 28 日（基金合同生效日）至 2015 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）	486,551,800.59	-	486,551,800.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,618,345.19	14,618,345.19
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）	486,551,800.59	14,618,345.19	501,170,145.78

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>虞俏依</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

圆信永丰优加生活股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1698号《关于准予圆信永丰优加生活股票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《圆信永丰优加生活股票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486,521,180.35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(2015)第1212号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《圆信永丰优加生活股票型证券投资基金基金合同》于2015年10月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为486,551,800.59份基金份额,其中认购资金利息折合30,620.24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《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰优加生活股票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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(含中期票据、可交换债券、可转换债券、中小企业私募债券等)、债券回购、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货、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的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金为股票型基金,基金的投资组合比例为:股票投资比例为基金资产的80%-95%,其中投资于优加生活相关股票不低于非现金基金资产的80%;权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%;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,现金或

到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；债券、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。

本财务报表由本基金的基金管理人圆信永丰基金管理有限公司于 2017 年 3 月 17 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》、《圆信永丰优加生活股票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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度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。比较财务报表的实际编制期间为 2015 年 10 月 28 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

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可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类

应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值；

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值；

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权

定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行股票有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；

若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税；

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	25,026,258.40	267,506,817.95
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	25,026,258.40	267,506,817.95

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	491,025,894.23	503,534,308.26	12,508,414.03
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	23,005,900.60	23,002,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	23,005,900.60	23,002,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	514,031,794.83	526,536,308.26	12,504,513.43
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	166,255,788.94	170,628,572.29	4,372,783.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	61,137,442.60	3,988,240.80
	银行间市场	-	-
	合计	61,137,442.60	3,988,240.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	227,393,231.54	235,754,255.69	8,361,024.15

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	50,000,000.00	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	50,000,000.00	-
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	9,396.34	79,750.34
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	1,338.10	1,648.40
应收债券利息	443,491.16	487,344.26

应收买入返售证券利息	1,493.06	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	114.00	39.60
合计	455,832.66	568,782.60

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	246,557.14	505,875.37
银行间市场应付交易费用	591.00	-
合计	247,148.14	505,875.37

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	977.96	-
预提审计费用	60,000.00	50,000.00
预提信息披露费用	80,000.00	-
合计	140,977.96	50,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	486,551,800.59	486,551,800.59
本期申购	531,390,338.18	531,390,338.18
本期赎回(以“-”号填列)	-522,670,714.77	-522,670,714.77
本期末	495,271,424.00	495,271,424.00

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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
上年度末	6,257,321.04	8,361,024.15	14,618,345.19
本期利润	61,510,401.46	4,143,489.28	65,653,890.74
本期基金份额交易产生的变动数	16,809,091.97	9,312,702.59	26,121,794.56
其中：基金申购款	49,683,495.47	40,666,866.94	90,350,362.41
基金赎回款	-32,874,403.50	-31,354,164.35	-64,228,567.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	84,576,814.47	21,817,216.02	106,394,030.49

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年10月28日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	1,170,730.46	461,742.12
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	30,022.83	8,156.29
其他	8,270.52	121.93
合计	1,209,023.81	470,020.34

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年10月28日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	796,898,131.05	218,944,821.78
减：卖出股票成本总额	734,261,144.40	212,972,094.61
买卖股票差价收入	62,636,986.65	5,972,727.17

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年10月28日(基金 合同生效日)至2015年12月 31日
债券投资收益——买卖债券(、债 转股及债券到期兑付)差价收入	3,447,936.88	1,516,062.54
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	3,447,936.88	1,516,062.54

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年10月28日(基金 合同生效日)至2015年12月 31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑 付)成交总额	69,799,921.29	12,099,739.69
减：卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成本总额	65,616,442.60	10,575,000.00
减：应收利息总额	735,541.81	8,677.15
买卖债券差价收入	3,447,936.88	1,516,062.54

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年10月28日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,422,675.48	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,422,675.48	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年10月28日(基金合 同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	4,143,489.28	8,361,024.15
——股票投资	8,135,630.68	4,372,783.35
——债券投资	-3,992,141.40	3,988,240.80
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	4,143,489.28	8,361,024.15

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年10月28日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	1,561,015.78	-
转换费收入	772.35	-
合计	1,561,788.13	-

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金不低于赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年10月28日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	2,362,816.42	777,915.53
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,362,816.42	777,915.53

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年10月28日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	40,000.00
银行划款手续费	9,453.06	220.00
账户服务费用	23,100.00	400.00
合计	172,553.06	90,620.00

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《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[2016]140号)，要求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，自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，2017年7月1日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。截至本财务报表批准报出日止，上述税收政策对本基金截止2016年12月31日止年度/期间的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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、基金销售机构、注册登记机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人、基金代销机构
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。

7.4.10 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

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。

7.4.10.2 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 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年10月28日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,130,918.18	1,303,902.83
其中:支付销售机构的客户维护费	2,147,149.03	494,039.00

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×1.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年10月28日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,188,486.50	217,317.13

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 0.25%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×0.25%/当年天数。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年10月28日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
基金合同生效日(2015年10月28日)持有的基金份额	-	4,999,000.00

期初持有的基金份额	4,999,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	4,999,000.00	-
期末持有的基金份额	-	4,999,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	1.0274%

注：基金管理人圆信永丰基金公司在本会计期间赎回本基金的交易委托圆信永丰基金公司直销柜台办理，适用费率 0.1%。

7.4.10.4.2 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以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年10月28日(基金合同生效日)至2015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	25,026,258.40	1,170,730.46	267,506,817.95	461,742.12

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2016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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
601801	皖新传媒	2016年9月6日	2017年9月6日	非公开发行	11.82	13.66	423,011	4,999,990.02	5,778,330.26	-

002821	凯莱英	2016年11月11日	2017年11月13日	老股配售	30.53	143.49	21,409	653,616.77	3,071,977.41	-
603823	百合花	2016年12月9日	2017年12月11日	老股配售	10.60	32.74	36,764	389,698.40	1,203,653.36	-
603660	苏州科达	2016年11月21日	2017年11月21日	老股配售	8.03	32.22	26,007	208,836.21	837,945.54	-
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股未上市	23.16	23.16	1,974	45,717.84	45,717.84	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	7.87	7.87	4,819	37,925.53	37,925.53	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	14.63	14.63	1,937	28,338.31	28,338.31	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股未上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股未上市	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 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
300271	华宇软件	2016年12月19日	重大资产重组	17.45	-	-	580,039	11,004,645.37	10,121,680.55	-

注：本基金截至2016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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期收益和较高预期风险水平的投资品种，

其预期收益和预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。

本基金的基金管理人实行全面风险管理与全员风险管理。基金管理人以各岗位目标责任制为基础的第一道内控防线，员工在自律的前提下，相互监督制衡。各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在授权范围内承担责任；以相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道内控防线，公司在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督责任；以公司督察长、监察稽核部门对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道防线，督察长、监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈；以董事会下属风险管理委员会对公司经营管理和基金运作中的合法合规性实行全面监督的第四道防线，风险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行兴业银行，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。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2015 年

12月31日：同)。

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12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	25,026,258.40	-	-	-	25,026,258.40
结算备付金	2,973,517.76	-	-	-	2,973,517.76
存出保证金	253,375.51	-	-	-	253,375.51
交易性金融资产	23,002,000.00	-	-	503,534,308.26	526,536,308.26
买入返售金融资产	50,000,000.00	-	-	-	50,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	26,111.12	26,111.12
应收利息	-	-	-	455,832.66	455,832.66
应收申购款	-	-	-	1,695,018.40	1,695,018.40
资产总计	101,255,151.67	-	-	505,711,270.44	606,966,422.11
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,685,395.82	2,685,395.82
应付赎回款	-	-	-	1,353,356.84	1,353,356.84
应付管理人报酬	-	-	-	749,218.98	749,218.98
应付托管费	-	-	-	124,869.88	124,869.88
应付交易费用	-	-	-	247,148.14	247,148.14
其他负债	-	-	-	140,977.96	140,977.96
负债总计	-	-	-	5,300,967.62	5,300,967.62
利率敏感度缺口	101,255,151.67	-	-	500,410,302.82	601,665,454.49
上年度末 2015年12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	267,506,817.95	-	-	-	267,506,817.95
结算备付金	3,663,099.17	-	-	-	3,663,099.17
存出保证金	87,998.01	-	-	-	87,998.01
交易性金融资产	25,254,783.40	-39,870,900.00	-	170,628,572.29	235,754,255.69
应收利息	-	-	-	568,782.60	568,782.60
资产总计	296,512,698.53	-39,870,900.00	-	171,197,354.89	507,580,953.42
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,111,624.25	5,111,624.25
应付管理人报酬	-	-	-	637,121.17	637,121.17

应付托管费	-	-	-	106,186.85	106,186.85
应付交易费用	-	-	-	505,875.37	505,875.37
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	6,410,807.64	6,410,807.64
利率敏感度缺口	296,512,698.53	-39,870,900.00		164,786,547.25	501,170,145.78

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

注：于 2016 年 12 月 31 日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.82% (2015 年 12 月 31 日：12.99%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2015 年 12 月 31 日：同)。

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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产占基金资产的 80%-95%；单只中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 10%；每个交易日终持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	503,534,308.26	83.69	170,628,572.29	34.05
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	503,534,308.26	83.69	170,628,572.29	34.05

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末(2016年12月31日)	上年度末(2015年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 2,639	-
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 2,639	-

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金成立尚不足一年，没有足够的经验数据计算其他价格风险的敏感性分析。

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

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 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 482,060,468.28 元,属于第二层次的余额为 44,475,644.24 元,无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日:第一层次 170,580,972.29 元,属于第二层次的余额为 65,173,283.40 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 2016 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(2015 年 12 月 31 日:同)。

(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)除公允价值外,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	503,534,308.26	82.96
	其中:股票	503,534,308.26	82.96
2	固定收益投资	23,002,000.00	3.79
	其中:债券	23,002,000.00	3.79
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	50,000,000.00	8.24
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	27,999,776.16	4.61

7	其他各项资产	2,430,337.69	0.40
8	合计	606,966,422.11	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	23,732,364.74	3.94
B	采矿业	12,338,754.71	2.05
C	制造业	333,321,700.75	55.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,527,319.01	2.75
F	批发和零售业	14,149,919.70	2.35
G	交通运输、仓储和邮政业	8,181,658.68	1.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,732,474.75	2.78
J	金融业	34,780,847.76	5.78
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	15,006,361.50	2.49
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,789,344.40	1.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,195,232.00	2.19
R	文化、体育和娱乐业	5,778,330.26	0.96
S	综合	-	-
	合计	503,534,308.26	83.69

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600535	天士力	586,000	24,313,140.00	4.04
2	002078	太阳纸业	3,261,780	21,788,690.40	3.62
3	002572	索菲亚	368,000	19,930,880.00	3.31
4	002299	圣农发展	915,000	19,416,300.00	3.23
5	600519	贵州茅台	56,000	18,712,400.00	3.11
6	600309	万华化学	866,100	18,647,133.00	3.10
7	000581	威孚高科	780,000	17,503,200.00	2.91
8	600584	长电科技	960,000	16,944,000.00	2.82
9	000498	山东路桥	2,080,043	16,494,740.99	2.74
10	002001	新和成	800,000	15,680,000.00	2.61
11	002117	东港股份	507,300	15,193,635.00	2.53
12	600057	象屿股份	1,304,901	15,006,361.50	2.49
13	300054	鼎龙股份	651,787	14,241,545.95	2.37
14	600511	国药股份	470,097	14,149,919.70	2.35
15	002179	中航光电	380,000	13,790,200.00	2.29
16	300232	洲明科技	860,050	12,831,946.00	2.13
17	600028	中国石化	2,280,731	12,338,754.71	2.05
18	601628	中国人寿	500,000	12,045,000.00	2.00
19	002690	美亚光电	557,082	11,787,855.12	1.96
20	601318	中国平安	330,000	11,691,900.00	1.94
21	600398	海澜之家	1,080,942	11,663,364.18	1.94
22	002026	山东威达	1,000,000	11,550,000.00	1.92
23	002519	银河电子	477,182	10,688,876.80	1.78
24	600978	宜华生活	1,000,000	10,650,000.00	1.77
25	300244	迪安诊断	329,976	10,559,232.00	1.76
26	300271	华宇软件	580,039	10,121,680.55	1.68
27	300115	长盈精密	381,450	9,940,587.00	1.65
28	600054	黄山旅游	609,928	9,789,344.40	1.63
29	600557	康缘药业	550,341	9,317,273.13	1.55
30	600004	白云机场	580,000	8,172,200.00	1.36
31	600500	中化国际	700,000	8,162,000.00	1.36
32	601939	建设银行	1,500,000	8,160,000.00	1.36
33	002624	完美世界	213,800	6,369,102.00	1.06
34	603015	弘讯科技	500,059	6,175,728.65	1.03
35	601801	皖新传媒	423,011	5,778,330.26	0.96
36	002595	豪迈科技	270,000	5,683,500.00	0.94
37	002456	欧菲光	150,678	5,165,241.84	0.86

38	000709	河北钢铁	1,500,000	5,010,000.00	0.83
39	002234	民和股份	200,003	4,316,064.74	0.72
40	000630	铜陵有色	1,001,100	3,083,388.00	0.51
41	002821	凯莱英	21,409	3,071,977.41	0.51
42	000858	五粮液	80,000	2,758,400.00	0.46
43	002044	美年健康	200,000	2,636,000.00	0.44
44	600987	航民股份	200,000	2,468,000.00	0.41
45	601009	南京银行	200,000	2,168,000.00	0.36
46	002521	齐峰新材	200,000	2,150,000.00	0.36
47	603823	百合花	36,764	1,203,653.36	0.20
48	600597	光明乳业	80,000	1,044,800.00	0.17
49	603660	苏州科达	26,007	837,945.54	0.14
50	601229	上海银行	26,167	609,167.76	0.10
51	600803	新奥股份	28,300	403,558.00	0.07
52	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.04
53	603416	信捷电气	2,790	139,723.20	0.02
54	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.02
55	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01
56	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.01
57	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
58	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
59	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01
60	603058	永吉股份	4,420	48,752.60	0.01
61	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.01
62	603228	景旺电子	1,974	45,717.84	0.01
63	603886	元祖股份	2,242	39,683.40	0.01
64	603689	皖天然气	4,819	37,925.53	0.01
65	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
66	603929	亚翔集成	4,582	32,578.02	0.01
67	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
68	603266	天龙股份	1,937	28,338.31	0.00
69	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
70	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
71	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
72	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
73	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.00
74	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
75	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
76	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00

77	300591	万里马	2,396	7,355.72	0.00
78	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002078	太阳纸业	35,726,055.91	7.13
2	002117	东港股份	27,711,534.93	5.53
3	002001	新和成	25,917,503.79	5.17
4	300232	洲明科技	22,888,390.82	4.57
5	600885	宏发股份	22,216,571.04	4.43
6	600309	万华化学	21,841,034.00	4.36
7	600535	天士力	21,478,207.12	4.29
8	603609	禾丰牧业	21,403,209.09	4.27
9	002456	欧菲光	21,280,893.13	4.25
10	300207	欣旺达	20,874,522.68	4.17
11	601801	皖新传媒	20,636,158.76	4.12
12	002572	索菲亚	20,245,152.00	4.04
13	600584	长电科技	19,865,092.72	3.96
14	002234	民和股份	19,076,161.40	3.81
15	300322	硕贝德	18,652,627.98	3.72
16	300070	碧水源	18,258,607.48	3.64
17	000581	威孚高科	18,064,982.86	3.60
18	600519	贵州茅台	17,886,114.00	3.57
19	600978	宜华生活	17,822,048.00	3.56
20	002179	中航光电	17,552,779.66	3.50
21	002690	美亚光电	16,232,057.56	3.24
22	300054	鼎龙股份	16,131,326.55	3.22
23	000498	山东路桥	16,050,734.01	3.20
24	002241	歌尔股份	15,764,570.07	3.15
25	002299	圣农发展	15,310,663.88	3.05
26	600511	国药股份	14,938,483.11	2.98
27	600057	象屿股份	14,852,253.37	2.96

28	600521	华海药业	13,843,493.70	2.76
29	600240	华业资本	13,834,714.00	2.76
30	002519	银河电子	13,660,516.25	2.73
31	600497	驰宏锌锗	13,361,174.37	2.67
32	002475	立讯精密	13,177,075.58	2.63
33	300100	双林股份	12,274,295.34	2.45
34	600398	海澜之家	12,196,040.72	2.43
35	600028	中国石化	12,050,632.02	2.40
36	002026	山东威达	11,869,476.69	2.37
37	601003	柳钢股份	11,564,902.00	2.31
38	300336	新文化	11,552,247.00	2.31
39	601318	中国平安	11,465,676.00	2.29
40	601628	中国人寿	11,462,588.00	2.29
41	300271	华宇软件	11,004,645.37	2.20
42	300244	迪安诊断	10,547,089.20	2.10
43	300115	长盈精密	10,301,727.29	2.06
44	002563	森马服饰	10,161,173.79	2.03
45	600500	中化国际	10,147,747.00	2.02

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002714	牧原股份	30,713,783.65	6.13
2	002234	民和股份	29,706,159.80	5.93
3	600885	宏发股份	27,861,779.28	5.56
4	002554	惠博普	26,658,546.11	5.32
5	002078	太阳纸业	22,405,392.36	4.47
6	300207	欣旺达	22,012,635.72	4.39
7	603609	禾丰牧业	21,952,229.78	4.38
8	002456	欧菲光	21,622,281.81	4.31
9	600497	驰宏锌锗	19,847,345.80	3.96
10	300322	硕贝德	19,651,642.80	3.92
11	601801	皖新传媒	19,486,658.23	3.89
12	300070	碧水源	18,123,148.20	3.62
13	300100	双林股份	16,954,821.30	3.38

14	002475	立讯精密	16,863,139.83	3.36
15	600325	华发股份	16,764,088.10	3.34
16	002241	歌尔股份	16,257,349.40	3.24
17	600521	华海药业	15,528,177.10	3.10
18	600240	华业资本	13,854,073.00	2.76
19	000060	中金岭南	13,822,687.00	2.76
20	002001	新和成	13,190,877.53	2.63
21	002701	奥瑞金	13,155,314.86	2.62
22	002727	一心堂	12,671,940.56	2.53
23	002117	东港股份	12,326,302.72	2.46
24	002563	森马服饰	11,785,779.00	2.35
25	601003	柳钢股份	10,949,995.32	2.18
26	002572	索菲亚	10,634,734.96	2.12
27	300232	洲明科技	10,041,056.02	2.00

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	1,059,031,249.69
卖出股票收入（成交）总额	796,898,131.05

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	23,002,000.00	3.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	23,002,000.00	3.82

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	019533	16 国债 05	230,020	23,002,000.00	3.82

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

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：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

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

注：根据基金合同约定，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	253,375.51
2	应收证券清算款	26,111.12
3	应收股利	-

4	应收利息	455,832.66
5	应收申购款	1,695,018.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,430,337.69

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

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
18,015	27,492.17	121,712,237.72	24.57%	373,559,186.28	75.43%

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	2,416,771.94	0.4880%

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	>100

注：报告期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间为 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（2015 年 10 月 28 日）基金份额总额	486,551,800.59
本报告期期初基金份额总额	486,551,800.59
本报告期基金总申购份额	531,390,338.18
减：本报告期基金总赎回份额	522,670,714.77
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	495,271,424.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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，基金管理人新聘任江涛先生为副总经理。

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。该审计机构已提供审计服务的持续年限为 2 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	
国信证券	2	860,804,347.95	46.69%	629,506.37	44.89%	-
兴业证券	2	269,529,528.31	14.62%	251,012.99	17.90%	-
华福证券	2	713,439,221.16	38.69%	521,738.42	37.21%	-

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
国信证券	521,450.60	0.78%	1,889,000,000.00	74.84%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	66,336,367.55	99.22%	635,000,000.00	25.16%	-	-

注：1. 本报告期内基金未新增交易单元。

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

- (1) 资金实力雄厚，财务状况良好；
- (2) 经营行为稳健文件规范，在业内有良好的声誉；
- (3) 内控制度健全，内部管理严格；，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行交易的需要；并能为基金提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员；
- (6) 具备较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较强的研究综合实力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、策略、行业、个股分析报告及丰富全面的信息服务；合作机构研究强项与我司研究重点匹配度高，能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他业务的开展提供良好的服务和支持。

3. 基金选择证券公司交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后, 确定拟选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 本基金管理人与和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下基金 2015 年年度资产净值的公告	证券日报	2016 年 1 月 1 日
2	圆信永丰基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 4 日上海证券交易所、深圳证券交易所发生指数熔断至收盘情形下调整旗下部分基金业务办理时间的公告	证券日报	2016 年 1 月 4 日
3	圆信永丰基金管理有限公司关于 2016 年 1 月 7 日上海证券交易所、深圳证券交易所发生指数熔断至收盘情形下调整旗下部分基金业务办理时间的公告	证券日报	2016 年 1 月 7 日
4	圆信永丰基金管理有限公司关于圆信永丰基金管理有限公司电子直销系统之微信交易端口开放上线的公告	证券日报	2016 年 7 月 1 日
5	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下基金 2016 年上半年年度资产净值的公告	证券日报	2016 年 7 月 1 日
6	圆信永丰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报	2016 年 9 月 7 日
7	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证券日报	2016 年 9 月 8 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

-

§ 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优加生活股票型证券投资基金设立的文件;
2. 《圆信永丰优加生活股票型证券投资基金基金合同》;

3. 《圆信永丰优加生活股票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
2017年3月31日