圆信永丰优加生活股票型证券投资基金2017年半年度报告摘要

2017年6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:兴业银行股份有限公司
送出日期:2017年8月29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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§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	579,771,126.52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

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2017年1月1日－2017年6月30日)
本期已实现收益	44,693,282.69
本期利润	85,556,264.13
加权平均基金份额本期利润	0.1519
本期基金份额净值增长率	12.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2498
期末基金资产净值	790,609,139.90
期末基金份额净值	1.364

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
过去一个月	7.32%	0.65%	4.16%	0.54%	3.16%	0.11%
过去三个月	6.40%	0.64%	4.68%	0.50%	1.72%	0.14%
过去六个月	12.26%	0.58%	8.10%	0.46%	4.16%	0.12%
过去一年	18.30%	0.64%	12.10%	0.54%	6.20%	0.10%
自基金合同生效起至今	36.40%	0.94%	1.60%	1.00%	34.80%	-0.06%

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

§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永丰证券投资信托股份有限公司合资设立,持股比例分别为51%和49%,注册资本贰亿元人民币。公司注册地位于厦门,主要业务经营团队位于上海,是厦门首家证券投资基金管理公司,也是海西首家两岸合资的证券投资基金管理公司。

截止2017年6月30日,公司旗下共管理九只开放式证券投资基金,分别为圆信永丰纯债债券型证券投资基金、圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金、圆信永丰优加生活股票型证券投资基金、圆信永丰兴融债券型证券投资基金、圆信永丰兴利债券型证券投资基金、圆信永丰强化收益债券型证券投资基金、圆信永丰润货币市场基金、圆信永丰多策略精选混合型证券投资基金及圆信永丰兴源灵活配置混合型证券投资基金。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、特定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 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

由于货币政策中性偏紧,权益部分的配置比重在二季度贴近下限。二季度初,绝大部分周期性行业的库存水平偏高,考虑到去库存,大宗商品价格下跌的压力,行业配置上偏向了大消费和大金融。大金融板块偏向保险和银行。

六月份一行三会的监管力度略有转向,利率水平下降,我们相对增加了前期跌幅较大,但依赖内生性增长,PEG合理的个股的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.364元(累计净值:1.364元);本报告期基金份额净值增长率为12.26%,业绩比较基准收益率为8.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于6月份经济数据全面超预期,市场开始对下半年的经济增长更为乐观,尤其对于出口、房地产投资和基建投资抱有比较乐观的预期。但是根据统计局的数据水泥上半年累计产量同比增长0.4%、粗钢同比增长4.6%、钢材同比增长1.1%,与投资者的乐观预期有较大的分化。我们认为大宗商品价格的上涨更多来自供应层面的收缩和环保安全检查、严格进口等干预,钢铁、煤炭、电解铝、造纸、铜等行业都受到了不同程度的影响。供应上的限制可能会带来大宗商品的暴涨,但周期性行业的盈利由全球的供需周期决定,最后可能会出现出口竞争力下降、中下游行业盈利恶化等负面效应。

我们对于流动性的看法相对中性,金融去杠杆的大方向下,我们预期证券市场主要以存量的资金为主。

行业配置上,我们增加了部分成长类股票的配置,关注公司高管增持且未来成长性仍然较好的个股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会相关规定和基金合同的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并设立估值委员会具体负责监督执行。估值委员会的成员由首席投资官或其授权代表、清算登记部分管领导、研究部负责人、监察稽核部总监、清算登记部总监和相关基金会计组成。估值委员会负责组织制定、评估和适时修订基金估值政策和程序,并指导和监督整个估值流程。估值委员会成员包括基金核算、行业研究等方面的业务骨干,均具有基金从业资格、专业胜任能力和丰富的工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内,本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债数据估值服务;本基金与中证指数有限公司根据《中证债券估值数据服务协议》而取得中证数据估值服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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双红利灵活配置混合型证券投资基金2017年半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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:2017年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产:			
银行存款		7,039,168.17	25,026,258.40
结算备付金		5,921,217.75	2,973,517.76
存出保证金		286,240.03	253,375.51
交易性金融资产		719,227,792.53	526,536,308.26
其中:股票投资		649,770,792.53	503,534,308.26
基金投资		-	-
债券投资		69,457,000.00	23,002,000.00
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		40,000,000.00	50,000,000.00
应收证券清算款		19,917,401.92	26,111.12
应收利息		1,218,917.51	455,832.66
应收股利		-	-
应收申购款		1,886,423.59	1,695,018.40
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		795,497,161.50	606,966,422.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,685,395.82
应付赎回款		2,572,551.92	1,353,356.84
应付管理人报酬		940,228.40	749,218.98
应付托管费		156,704.72	124,869.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,065,798.11	247,148.14
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		152,738.45	140,977.96
负债合计		4,888,021.60	5,300,967.62
所有者权益:			
实收基金		579,771,126.52	495,271,424.00
未分配利润		210,838,013.38	106,394,030.49
所有者权益合计		790,609,139.90	601,665,454.49
负债和所有者权益总计		795,497,161.50	606,966,422.11

注:报告截止日2017年6月30日,基金份额净值1.364元,基金份额总额579,771,126.52份。

6.2 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:2017年1月1日至2017年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入		93,705,493.92	49,403,275.71
1.利息收入		2,043,592.19	1,275,813.94
其中:存款利息收入		322,646.43	852,652.79
债券利息收入		840,762.47	276,470.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		880,183.29	146,690.17
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		50,256,309.50	29,458,053.11
其中:股票投资收益		45,305,013.93	24,239,732.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益		16,362.82	3,407,127.26
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		4,934,932.75	1,811,193.81
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		40,862,981.44	17,619,590.30
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		542,610.79	1,049,818.36
减:二、费用		8,149,229.79	5,052,211.43
1.管理人报酬		5,307,065.03	3,131,157.84
2.托管费		884,510.82	521,859.68
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,865,562.85	1,319,490.96
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		92,091.09	79,702.95
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		85,556,264.13	44,351,064.28
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		85,556,264.13	44,351,064.28

6.3 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:2017年1月1日 至 2017年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30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)	495,271,424.00	106,394,030.49	601,665,454.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	85,556,264.13	85,556,264.13
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)	84,499,702.52	18,887,718.76	103,387,421.28
其中:1.基金申购款	261,408,252.79	67,572,704.64	328,980,957.43
2.基金赎回款	-176,908,550.27	-48,684,985.88	-225,593,536.15
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)	579,771,126.52	210,838,013.38	790,609,139.90

项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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(本期净利润)	-	44,351,064.28	44,351,064.28
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)	-117,512,577.13	-2,516,776.10	-120,029,353.23
其中:1.基金申购款	222,724,090.79	22,497,254.24	245,221,345.03
2.基金赎回款	-340,236,667.92	-25,014,030.34	-365,250,698.26
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)	369,039,223.46	56,452,633.37	425,491,856.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

______董晓亮______ ______于娟______ ____虞俏依____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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》注册,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,现金或者到期日在一年以内的政府债券合计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8月29日批准报出。

6.4.2 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6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年1月1日至2017年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

6.4.4.3 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。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,307,065.03	3,131,157.84
其中:支付销售机构的客户维护费	1,266,430.10	1,075,125.31

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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	884,510.82	521,859.68

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。

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.7.4.2 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:报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.7.5 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1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	7,039,168.17	271,538.00	5,467,436.59	832,384.42

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。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

注:报告期内本基金无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.8 期末(2017年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

6.4.10.1.1 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
601801	皖新传媒	2016年9月6日	2017年9月6日	非公开发行流通受限	11.82	13.43	423,011	4,999,990.02	5,681,037.73	-
002821	凯莱英	2016年11月11日	2017年11月13日	老股配售流通受限	30.53	72.97	42,818	653,616.77	3,124,429.46	-
603660	苏州科达	2016年11月21日	2017年11月21日	老股配售流通受限	8.03	40.95	26,007	208,836.21	1,064,986.65	-
603823	百合花	2016年12月9日	2017年12月11日	老股配售流通受限	10.60	21.18	36,764	389,698.40	778,661.52	-
002859	洁美科技	2017年3月24日	2018年3月26日	老股配售流通受限	29.82	73.00	6,666	198,780.12	486,618.00	-
002860	星帅尔	2017年3月31日	2018年4月2日	老股配售流通受限	19.81	48.90	7,980	158,083.80	390,222.00	-
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股未上市流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股未上市流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股未上市流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股未上市流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股未上市流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股未上市流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股未上市流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股未上市流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股未上市流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.8.2 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
600057	象屿股份	2017年6月27日	重大事项	10.17	2017年7月4日	10.17	1,304,901	14,852,253.37	13,270,843.17	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2017年06月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为630,695,228.53元,属于第二层次的余额为88,532,564.00元,无属于第三层次的余额(于2016年12月31日,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。)。

(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06月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定:(a)金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益),不征收增值税;(b)纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期,不属于金融商品转让;(c)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外,根据财政部、国家税务总局于2017年1月10日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外,截至资产负债表日本基金无需说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	649,770,792.53	81.68
	其中:股票	649,770,792.53	81.68
2	固定收益投资	69,457,000.00	8.73
	其中:债券	69,457,000.00	8.73
	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	40,000,000.00	5.03
	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	12,960,385.92	1.63
7	其他各项资产	23,308,983.05	2.93
8	合计	795,497,161.50	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	380,898,921.23	48.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	30,279,523.56	3.83
F	批发和零售业	17,120,000.00	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	15,587,175.60	1.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,421,639.62	1.07
J	金融业	131,908,974.10	16.68
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	16,022,843.17	2.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,848,657.30	1.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,247,020.22	2.31
R	文化、体育和娱乐业	17,436,037.73	2.21
S	综合	-	-
	合计	649,770,792.53	82.19

7.2.2 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。

7.3 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	601601	中国太保	1,159,200	39,262,104.00	4.97
2	601318	中国平安	780,000	38,695,800.00	4.89
3	000651	格力电器	750,000	30,877,500.00	3.91
4	002179	中航光电	910,000	28,382,900.00	3.59
5	000581	威孚高科	999,892	25,897,202.80	3.28
6	002572	索菲亚	600,000	24,600,000.00	3.11
7	601939	建设银行	3,900,000	23,985,000.00	3.03
8	600535	天士力	530,000	22,016,200.00	2.78
9	600557	康缘药业	1,280,000	21,260,800.00	2.69
10	000858	五粮液	380,000	21,150,800.00	2.68

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601601	中国太保	37,995,601.00	6.32
2	000651	格力电器	29,895,619.47	4.97
3	601318	中国平安	24,070,171.66	4.00
4	002572	索菲亚	23,658,794.70	3.93
5	601939	建设银行	23,547,751.00	3.91
6	000858	五粮液	22,241,909.32	3.70
7	300271	华宇软件	20,177,206.07	3.35
8	600827	百联股份	19,847,432.45	3.30
9	601688	华泰证券	19,699,366.77	3.27
10	000895	双汇发展	19,440,694.23	3.23
11	002081	金螳螂	18,980,389.80	3.15
12	600068	葛洲坝	18,157,691.96	3.02
13	002250	联化科技	17,186,226.62	2.86
14	600987	航民股份	16,168,506.40	2.69
15	600195	中牧股份	15,952,906.24	2.65
16	000070	特发信息	15,915,936.72	2.65
17	600350	山东高速	15,272,002.17	2.54
18	002343	慈文传媒	14,888,986.91	2.47
19	002027	分众传媒	14,755,452.33	2.45
20	600557	康缘药业	14,728,544.18	2.45
21	300115	长盈精密	14,338,307.46	2.38
22	601933	永辉超市	13,646,246.60	2.27
23	002074	国轩高科	12,765,184.70	2.12
24	600004	白云机场	12,272,708.00	2.04
25	002179	中航光电	12,035,193.15	2.00

7.4.2 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	002572	索菲亚	31,388,508.62	5.22
2	300271	华宇软件	29,338,517.71	4.88
3	600004	白云机场	23,480,977.20	3.90
4	002078	太阳纸业	22,070,597.29	3.67
5	600068	葛洲坝	22,019,459.65	3.66
6	600584	长电科技	20,496,117.59	3.41
7	600309	万华化学	20,018,744.93	3.33
8	600028	中国石化	19,980,269.04	3.32
9	601628	中国人寿	17,857,506.04	2.97
10	300115	长盈精密	17,259,026.38	2.87
11	600519	贵州茅台	17,102,473.46	2.84
12	002299	圣农发展	16,811,825.98	2.79
13	002250	联化科技	16,658,998.78	2.77
14	002001	新 和 成	15,442,726.06	2.57
15	002343	慈文传媒	15,306,897.78	2.54
16	600511	国药股份	15,153,731.84	2.52
17	002027	分众传媒	14,876,881.06	2.47
18	600827	百联股份	13,732,038.70	2.28
19	002456	欧菲光	13,674,777.46	2.27
20	000538	云南白药	12,933,941.34	2.15
21	601229	上海银行	12,738,702.02	2.12
22	000858	五粮液	12,289,299.93	2.04

7.4.3 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	735,339,707.01
卖出股票收入(成交)总额	675,293,617.51

7.5 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	50,047,000.00	6.33
	其中:政策性金融债	50,047,000.00	6.33
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	19,410,000.00	2.46
9	其他	-	-
10	合计	69,457,000.00	8.79

7.6 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	150201	15国开01	300,000	29,997,000.00	3.79
2	150207	15国开07	200,000	20,050,000.00	2.54
3	111608269	16中信CD269	200,000	19,410,000.00	2.46

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

本基金前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

7.12.3 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	286,240.03
2	应收证券清算款	19,917,401.92
3	应收股利	-
4	应收利息	1,218,917.51
5	应收申购款	1,886,423.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,308,983.05

7.12.4 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。

7.12.5 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不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
19,432	29,835.90	230,984,537.63	39.84%	348,786,588.89	60.16%

8.3 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	2,456,332.79	0.4237%

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。

8.4 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	>100

§9 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	495,271,424.00
本报告期基金总申购份额	261,408,252.79
减:本报告期基金总赎回份额	176,908,550.27
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	579,771,126.52

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内,本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
浙商证券	2	76,745,284.26	5.46%	56,123.94	5.27%	-
国信证券	2	661,788,392.67	47.09%	483,966.23	45.46%	-
兴业证券	2	184,480,290.51	13.13%	171,807.30	16.14%	-
东兴证券	2	76,141,122.75	5.42%	55,681.83	5.23%	-
华福证券	2	406,168,105.29	28.90%	297,029.41	27.90%	-

10.7.2 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
浙商证券	-	-	160,000,000.00	3.09%	-	-
国信证券	1,104,132.00	100.00%	2,631,000,000.00	50.85%	-	-
兴业证券	-	-	838,000,000.00	16.20%	-	-
东兴证券	-	-	230,000,000.00	4.45%	-	-
华福证券	-	-	1,315,000,000.00	25.42%	-	-

注:1、本报告期内基金新增4个证券公司交易单元,分别为东兴证券股份有限公司上交所及深交所交易单元,浙商证券股份有限公司上交所及深交所交易单元。2、本基金管理人负责选择证券经营机构,租用其交易单元作为本基金的交易单元。选择租用证券公司基金交易单元的选择标准如下:

(1)资金实力雄厚,财务状况良好;

(2)经营行为稳健文件规范,在业内有良好的声誉;

(3)内控制度健全,内部管理严格,并能满足基金运作高度保密的要求;

(4)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行交易的需要;并能为基金提供全面的信息服务;

(5)研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员;

(6)具备较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较强的研究综合实力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、策略、行业、个股分析的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需求,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 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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:本报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 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
2017年8月29日