

圆信永丰优加生活股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2016 年第 2 号)

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

二零一六年十二月

重要提示

本基金经中国证监会 2015 年 7 月 14 日证监许可〔2015〕1698 号文准予募集注册，基金合同已于 2015 年 10 月 28 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，投资者申购、赎回失败的风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金的投资范围中包括中小企业私募债券，该券种具有较高的流动性风险和信用风险，可能增加本基金总体风险水平。中小企业私募债券是指中小微型企业在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券，其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。因此，中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。本基金以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。由于股指期货交易采用保证金交易制度，保证金交易具有杠杆性，本基金存在杠杆性风险、到期日风险、变现损失风险、强行平仓风险、强行减仓风险、保证金流动性风险。

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。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，自主判断基金的投资价值，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2016年10月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日（未经审计）。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：圆信永丰基金管理有限公司

住所：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02单元之175

办公地址：中国上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦19楼

成立时间：2014年1月2日

法定代表人：洪文瑾

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可（2013）1514号

注册资本：20,000万元人民币

股权结构：厦门国际信托有限公司（以下简称“厦门国际信托”）持有51%的股权；永丰证券投资信托股份有限公司（以下简称“永丰投信”）持有49%的股权。

电话：（021）60366000 传真：（021）60366009

客服电话：400-607-0088

网址：www.gtsfund.com.cn

联系人：严晓波

二、主要人员情况

（一）董事会成员

董事长：

洪文瑾女士，公司董事长，厦门大学工商管理硕士。历任厦门建发集团财务部副经理，厦门建发信托投资公司副总经理、总经理，厦门国际信托有限公司总经理、董事长，2012年11月起兼任厦门金圆投资集团有限公司副总经理。

独立董事：

戴亦一先生，公司独立董事，厦门大学研究生学历，经济学博士学位。历任厦门大学经济学院计统系讲师、副教授；厦门大学管理学院副教授/EMBA中心副主任、教授/EMBA中心主任、教授/博导/副院长、教授/博导；福建新华都购物广场股份有限公司独立董事、厦门兴业能源控股股份有限公司独立董事。

朱孟楠先生，公司独立董事，厦门大学金融学博士。历任厦门大学经济学院财金系助教、讲师、副教授、教授、博士生导师，厦门大学经济学院金融系教授、博士生导师、系主任，厦门大学经济学院副院长。

股东董事：

郑木清先生，公司董事，复旦大学国际金融学博士、中国社会科学院法学博士后、中共中央党校哲学博士后。历任中国建设银行总行利率处负责人，海通证券股份有限公司高级证券分析师、投资经理、中外合资海富通基金管理公司筹备组成员，海富通基金管理公司总裁特别助理，甘肃省人民政府办公厅主任助理、厅领导成员，东吴基金管理公司总裁助理、量化投资总监兼量化投资部总经理；现任厦门金圆投资集团有限公司总经理助理，兼任金圆资本管理（厦门）有限公司董事长、总经理。

董晓亮先生，公司董事，厦门大学经济学博士。历任国贸期货上海代表处出市代表负责人、研发部研究员，兴业证券厦门投资银行总部业务经理，国贸期货总经理助理、副总经理、常务副总经理、总经理，海通期货副总经理，金圆集团投资部副总经理；现任圆信永丰基金管理有限公司总经理。

许如玫女士，公司董事，美国德州州立大学企业管理硕士。历任建弘国际投资顾问研究员，建弘证券经理，建弘投信基金经理、营销企划部门主管，永丰金资产管理(亚洲)董事总经理，永丰证券投资信托股份有限公司总经理；现任永丰金融控股股份有限公司投资长办公室主任。

吴嘉钦先生，公司董事，台湾科技大学硕士。历任宝来证券国际金融部副总经理，宝来投信综合通路处及投资产品中心副总经理，元大宝来投信通路事业部资深副总经理；现任永丰证券投资信托股份有限公司总经理。

蔡隆裕先生，公司董事，国立台湾大学电机所硕士。历任永丰金证券股份有限公司副总经理，永丰金资本(亚洲)有限公司董事，SPS Asset Management Ltd. 董事，永丰金亚洲有限公司董事；现任永丰金证券(亚洲)有限公司董事总经理。

(二) 监事会成员

薛经武先生，公司监事长，荷兰伊拉斯莫斯大学鹿特丹管理学院研究所企业管理硕士。历任环球经济社研究员，台湾经济研究院专案特约研究员，欧洲品质管理基金会专案特约研究员，日商日兴证券台北分公司研究部主管，永丰金控总经理办公室副总经理，永丰金证券(亚洲)有限公司上海代表处代表。

胡荣炜先生，公司监事，厦门大学工商管理硕士。历任中国银行厦门市分行营业部职员、风险管理处业务审查科副科长、风险管理部尽职调查科科长，柯达(中国)股份有限公司亚太影像材料制造乐凯并购项目财务经理，柯达(厦门)数码影像有限公司财务经理，柯达中国区制造财务内控总监，厦门磐基大酒店有限公司集团副总经理，厦门金圆投资集团有限公司投资经理，厦门市创业投资有限公司总经理助理、副总经理；现任厦门国际信托有限公司副总经理。

吴焯女士，公司职工监事、综合管理部总监，华东师范大学本科学历。历任江苏联合信托投资有限公司人事行政主管、德邦证券有限责任公司人力资源部薪酬福利经理，湘财证券股份有限公司人力资源与发展总部人事经理。

高晶女士，公司职工监事、监察稽核部总监，上海交通大学金融英语及国际贸易双学士。历任普华永道中天会计师事务所审计鉴证部金融分部高级审计员，上投摩根基金管理有限公司监察稽核部资深内部审计经理。

(三) 基金管理人总经理及其他高级管理人员

董晓亮先生，公司总经理，简历见上。

吕富强先生，公司督察长，厦门大学法学博士。历任华东地质学院助教，厦门国际信托投资公司证券总部投资银行部业务主办，厦门国际信托投资公司信托部业务主办、市场开发部副经理、风险控制部经理，厦门国际信托合规管理部总经理、风险管理部总经理。

江涛先生，公司副总经理，安徽大学经济学硕士。历任交通银行安徽分行国际部副总经理、交通银行东京分行国际部总经理、交通银行安徽分行个金部总经理，融通基金北京分公司副总经理、融通基金上海分公司总经理。

(四) 本基金基金经理

洪流先生，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。

范妍女士，复旦大学管理学硕士，现任公司基金投资部下设权益投资部副总监。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。

（五）投资决策委员会成员

主席：董晓亮先生，简历见上。

成员：

洪流先生，简历见上。

李明阳先生，北京大学软件工程（金融管理方向）硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司研究部副总监。历任圆信永丰基金管理有限公司研究部研究员。

余文龙先生，上海财经大学金融数学与金融工程博士，现任圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设固定收益投资部总监。2011-2014年任职上海申银万国证券研究所债券高级分析师，荣获过2011-2013年新财富固定收益最佳分析师团队第一名和第二名，2014-2016年5月任职于中信证券资产管理部资产管理业务副总裁、年金保险组固定收益投资经理。

王琳女士，复旦大学世界经济研究所硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司交易部总监。历任国泰君安证券交易员、国联安基金管理有限公司交易员、金元惠理基金管理有限公司交易部总监。

范妍女士，简历见上。

督察长有权列席公募基金投资决策委员会会议，经总经理批准的其他人员可列席参会。

（六）上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

（一）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（二）办理基金备案手续；

（三）对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

（四）按照《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

（五）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（六）编制季度、半年度和年度基金报告；

（七）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（八）办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(九) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(十) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(十一) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(十二) 有关法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

(一) 本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会有关规定的行为发生。

(二) 本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- 1、将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- 2、不公平地对待管理人管理的不同基金财产；
- 3、利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- 4、向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- 5、侵占、挪用基金财产；
- 6、泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- 7、玩忽职守，不按照规定履行职责；
- 8、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

(三) 本基金管理人承诺加强员工管理和培训，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- 1、越权或违规经营；
- 2、违反《基金合同》或《托管协议》；
- 3、故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- 4、在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- 5、拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- 6、玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- 7、违反现行有效的有关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的

基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

8、除按基金管理人制度进行基金、特定客户资产管理计划运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

9、协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

10、违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

11、贬损同行，以抬高自己；

12、以不正当手段谋求业务发展；

13、有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

14、在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

15、其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

（四）基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1、承销证券；

2、违反规定向他人贷款或者提供担保；

3、从事承担无限责任的投资；

4、买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

5、向其基金管理人、基金托管人出资；

6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

7、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按照变更后的规定执行。

（五）基金经理承诺

1、依照有关法律、法规和《基金合同》的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取不当利益；

3、不违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的内部控制制度

基金管理人的内部风险控制制度包括内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等。内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，对各项基本管理制度的总揽和指导。内部控制大纲明确了内部控制目标和原则、内部控制组织体系、内部控制制度体系、内部控制环境、内部控制措施等。基本管理制度包括风险控制制度、基金投资管理制度、基金绩效评估考核制度、集中交易制度、基金会计制度、信息披露制度、信息系统管理制度、员工保密制度、危机处理制度、监察稽核制度等。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、工作要求、业务流程等的具体说明。

根据基金管理业务的特点，公司设立顺序递进、权责统一、严密有效的四道内控防线：

公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

1、建立以各岗位目标责任制为基础的第一道内控防线。员工积极发挥主观能动性，在严于自律的前提下，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，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任。

2、建立相关部门、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。

3、建立以公司督察长、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。

4、建立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。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人的基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

成立日期：1988 年 8 月 26 日

注册资本：人民币 190.52 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

托管部门联系人：李峰

电话：021-52629999

传真：021-62159217

二、发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 190.52 亿元。开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务，坚持走差异化发展道路，经营实力不断增强。截至 2015 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 5.30 万亿元，实现营业收入 1543.48 亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润 502.07 亿元。

三、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合处、运营管理处、稽核监察处、科技支持处、市场处、委托资产管理处、企业年金中心等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

四、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截止 2016 年 9 月 30 日，兴业银行已托管开放式基金 106 只，托管基金财产规模 4118.21 亿元。

五、基金托管人的内部控制制度

1、内部风险控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部风险控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1) 全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2) 独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3) 相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

(5) 防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

(6) 有效性原则：内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

(7) 审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设。

(8) 责任追究原则：各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

4、内部风险控制措施实施

(1) 制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2) 建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3) 风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制

定并实施风险控制措施。

(4) 相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

(5) 人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6) 应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

六、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《基金合同》、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金的投资监督和检查自基金合同生效之日开始。基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《基金合同》、托管协议或有关基金法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

(一) 直销机构

1、圆信永丰基金管理有限公司直销中心

上海直销中心办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦
19 楼

电话：021-60366073

传真：021-60366001

厦门直销中心办公地址：厦门市思明区展鸿路 82 号金融中心大厦 21 楼
2102 室

电话：0592-3016513

传真：0592-3016501

网址: www.gtsfund.com.cn

2、电子直销

(1) 名称: 圆信永丰基金管理有限公司电子直销

网站: www.gtsfund.com.cn

客服电话: 4006070088; 021-60366818

(2) 名称: 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

圆信永丰基金微信公众号: [gtsfund4006070088](https://www.gtsfund.com.cn)

客服电话: 4006070088; 021-60366818

(二) 其他销售机构

1、兴业银行股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 154 号

办公地址: 上海市江宁路 168 号

法定代表人: 高建平

客服电话: 95561

公司网址: www.cib.com.cn

2、华福证券有限责任公司

注册地址: 福州五四路 157 号新天地大厦 7-8 层

法定代表人: 黄金琳

客服电话: 4008896326

公司网址: www.gfhfzq.com.cn

3、兴业证券股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 268 号

法定代表人: 兰荣

客服电话: 95562

公司网址: www.xyzq.com.cn

4、中国工商银行股份有限公司

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 姜建清

客服电话: 95588

公司网址: www.icbc.com.cn

5、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址: 杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室

住所: 杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室

法定代表人：陈柏青

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

6、上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

7、上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 路 1033 室

住所：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

客服电话：400-067-6266

公司网址：www.leadfund.com.cn

8、中正达广投资管理有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

客服电话：4006767523

公司网址：<http://www.zzwealth.cn>

9、上海陆金所资产管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

电话：4008219031

公司网址：www.lufunds.com

10、浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

办公地址：杭州市拱墅区登云路 55 号（锦昌大厦）一楼金观诚财富

法定代表人：徐黎云

电话：4000680058

公司网址：<http://www.jincheng-fund.com/>

11、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

电话：4008215399

公司网址：www.noah-fund.com

12、上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

联系人：王亚丹

客服电话：4008210203

13、上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：陆敏

客服电话：4007009665

公司网址：www.ehowbuy.com

14、恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

办公地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

客服电话：4001966188

公司网址：www.cnht.com.cn

15、申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

客服电话：4008000562

公司网址：www.swhysc.com

16、申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦
20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦

20 楼 2005 室

法定代表人：李季

联系人：黄莹

客服电话：4008000562

公司网址：www.hysec.com

17、厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

法定代表人：林松

客服电话：400-918-0808

公司网址：www.xds.com.cn

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和《基金合同》等的规定，调整销售机构或选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时履行信息披露义务。

二、登记机构

名称：圆信永丰基金管理有限公司

住所：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 02 单元之 175

办公地址：中国上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 19 楼

法定代表人：洪文瑾

联系人：严晓波

客户服务电话：400-607-0088

传真：（021）60366009

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

经办律师：安冬、陆奇

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：（021）23238888 传真：（021）23238800

联系人：陈邈迪

经办注册会计师：单峰、陈邈迪

第四部分 基金概况

名称：圆信永丰优加生活股票型证券投资基金

类型：股票型证券投资基金

第五部分 基金份额的申购与赎回

一、申购费用和赎回费用

1、申购费

本基金基金份额的申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。本基金基金份额具体申购费率如下：



注：M 为申购金额，单位为人民币元

2、本基金基金份额的赎回费率如下：



注：Y 为基金份额持有期限；1 个月为 30 日，1 年为 365 日

3、本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金对基金份额持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对基金份额持续持有期长于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对基金份额持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对基金份额持续持有期长于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产。未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购

费率和赎回费率。

二、本基金申购份额的计算

本基金申购采用“金额申购”的方式。基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。

1、申购份额的计算公式为：

(1) 申购费用适用比例费率时：

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

(2) 申购费用适用固定金额时：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

2、上述申购份额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

三、本基金赎回金额的计算

本基金采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

赎回总额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

第六部分 基金的投资目标和投资范围

一、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。

二、投资范围

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。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资组合比例会做相应调整。

第七部分 基金的投资策略

（一）资产配置策略

在大类资产配置上，在具备足够多本基金所定义的投资标的时，优先考虑股票类资产的配置，剩余资产将配置于债券和现金等大类资产上。除主要的股票投资策略外，本基金还可通过债券投资策略以及衍生工具投资策略，进一步为基金组合规避风险、增强收益。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。

（二）股票配置策略

（1）优加生活类股票的界定

本基金的股票投资包含健康和生活两大主题。健康主题对应的是有利于公众建立健康体质和生活的行业或公司，如生活消费、商业贸易、养老医疗、文化教育、信息传媒、旅游航空、节能环保、体育产业等。生活主题对应的是符合公众消费趋势，关系国计民生的行业和公司，如现代农业、食品安全、智慧城市、平安生活、清洁能源、园林装饰、绿色建筑、现代物流、高端装备制造、高端汽车零配件、信息消费、信息安全、新材料以及能够提高人们精神品质、便捷日常生活的移动、互联网技术等。本基金将不低于80%的非现金基金资产投资于健康和生活这两大主题的证券资产。根据前文的定义，本基金的优加生活相关行业由餐饮旅游、食品饮料、医药生物、交通运输、休闲服务、传媒、电子、计算机、通信、农林牧渔、纺织服装、轻工制造、商业贸易、建筑材料、建筑装饰、国防军工、汽车、家电、机械设备等多个行业组成。

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。

若未来由于技术进步或政策变化导致本基金优加生活相关行业和公司相关业务的覆盖范围发生变动，基金管理人有权适时对上述定义进行补充和修订。

（2）行业配置策略

本基金从行业成长性、行业估值水平以及市场认知程度等三个维度研究优加生活相关行业所处生命周期的位置，寻找景气度高的子行业。在此基础上确定基金权益类资产在优加生活相关行业中的配置方案。

（3）个股精选策略

在行业配置的基础上，本基金管理人将采用“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，重点分析企业成长性和投资价值，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。

基本面研究主要包括公司的成长性评估和投资价值评估。成长性评估主要综合考虑定性因素包括相关领域的新技术、新研发成果、新生产模式、新商业模式、核心竞争力、业绩驱动因素等和定量因素包括市场需求量、产品占有率等的市场容量指标，主营业务收入、EBITDA、净利润等的预期增长率指标，公司营运指标（如固定资产周转率等）以及经营杠杆指标等，对公司的成长性和盈利的持续增长前景进行综合评价。投资价值评估是根据一系列历史和预期的财务指标，结合定性考虑，分析公司盈利稳固性，判断相对投资价值，主要指标包括：

EV/EBITDA，EV/Sales、P/E、P/B、股息率、ROE、经营利润率和净利润率等。分析师将根据行业特点选择合适的指标进行估值。

（三）债券投资策略

在债券投资方面，基金管理人将通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，确定资产在非信用类固定收益类证券（国债、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券（如企业债、公司债等）之间的配置比例，灵活应用期限结构策略、类属策略、信用策略、息差策略、互换策略等，在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。

1、债券资产配置策略

在宏观经济趋势研究、货币及财政政策趋势研究的基础上，以中长期利率趋势分析和债券市场供求关系研究为核心，自上而下地决定债券组合久期、动态调整各类金融资产比例，结合收益率水平曲线形态分析和类属资产相对估值分析，优化债券组合的期限结构和类属配置。

(1) 久期配置

基金管理人将通过积极主动地预测市场利率的变动趋势，相应调整债券组合的久期配置，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。在确定债券组合久期的过程中，基金管理人将在判断市场利率波动趋势的基础上，根据债券市场收益率曲线的当前形态，通过合理假设下的情景分析和压力测试，最后确定最优的债券组合久期。

根据对市场利率变化趋势的预期，可适当调整组合久期，预期市场利率水平将上升时，适当降低组合久期；预期市场利率将下降时，适当提高组合久期。

(2) 期限结构配置

对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，在给定组合久期以及其它组合约束条件的情形下，通过建立债券组合优化数量模型，确定最优的期限结构。

(3) 类属配置

对不同类型固定收益品种的利率风险、信用风险、流动性等因素进行分析，研究各类型投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

2、信用类固定收益类证券的投资策略

对企业债、公司债和短期融资券等信用类固定收益类证券采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。影响信用债信用风险的因素分为行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等五个方面。

为控制信用风险，基金管理人将根据国家有权机构批准或认可的信用评级机构提供的信用评级，并主要依靠内部评级系统分析信用债的相对信用水平、违约风险及理论信用利差。

3、息差策略

利用回购等方式融入低成本资金，购买较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。

4、互换策略

不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，基金管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，赚取收益级差。

5、可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转债的选择结合其债性和股性特征，在对公司

基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券，获取稳健的投资回报。

6、资产支持证券投资策略

本基金通过分析资产支持证券对应资产池的资产特征，来估计资产违约风险和提前偿付风险，根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流支付，并利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。同时还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，控制资产支持证券投资的风险，以获取较高的投资收益。

7、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券由于该券种的发行主体资质相对较弱，且存在信息透明度较低等问题，因而面临更大的信用风险，属于高风险高收益品种，未来有可能出现债券到期后企业不能按时清偿债务的情况，从而导致基金资产的损失。

本基金将从发行主体所处行业的稳定性、未来成长性，以及企业经营、现金流状况、抵质押及担保增信措施等方面优选信用资质相对较强的高收益债进行投资。严格执行分散化投资策略，分散行业、发行人和区域集中度，以避免行业或区域性事件对组合造成的集体冲击。

（四）股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

（五）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。在进行权证投资时，基金管理人将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性，通过限量投资、趋势投资、优化组合、获利等投资策略进行权证投资。基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

第八部分 基金的投资限制

一、基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按照变更后的规定执行。

二、基金投资组合比例限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%；投资于本基金定义的优加生活相关股票不低于非现金基金资产的 80%；
- (2) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- (3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (4) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (5) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (9) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过

该资产支持证券规模的 10%；

(10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(11) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(12) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(14) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关约定；

6) 本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(15) 本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(16) 本基金的基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（11）项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，

但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合《基金合同》的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自《基金合同》生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，则本基金投资以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%

沪深 300 指数是从上海和深圳证券交易所中选取具有代表性的 300 只成份股编制而成的指数，综合反映了 A 股市场的整体表现。中债综合指数是中国全市场债券指数，由中央国债登记结算有限责任公司编制，并在中国债券网公开发布，具有较强的权威性和市场影响力，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成份债券包括国债、企业债券等所有主要债券种类。综合考虑基金资产配置与市场指数代表性等因素，本基金选用沪深 300 指数和中债总指数加权作为本基金的投资业绩比较基准。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场中出现更适用于本基金的指数，本基金可以在征得基金托管人同意后报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的品种。

第十一部分 基金投资组合报告（未经审计）

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 9 月 30 日。

1. 报告期末基金资产组合情况

■
2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

■
3. 报告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

■
4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

■
5. 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债券投资明细

■
6. 报告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. 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. 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 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。

9.2 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。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

10.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同约定，本基金不参与国债期货交易。

投资组合报告附注 11.1

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。

11.2

本基金前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

11.3 其他资产构成

■

11.4 报告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。

11.5 报告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。

11.6 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。

第十二部分 基金的业绩

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。

历史时间段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

圆信永丰优加生活

■

第十三部分 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。

第十四部分 其他应披露事项



第十五部分 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对圆信永丰优加生活股票型证券投资基金招募说明书的内容进行了更新，招募说明书更新（2016年第2号）的主要更新内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据和净值表现的截止日期。
- 2、在“第三部分 基金管理人”部分，更新了主要人员的相关信息。
- 3、在“第四部分 基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关信息。
- 4、在“第五部分 相关服务机构”部分，（1）增加了相关的直销机构之电子直销渠道，其中新增电子直销渠道的事宜已公告；（2）更新了相关的其他销售机构，其中新增销售机构的事宜已公告。
- 5、在“第九部分 基金的投资”部分，更新了“十、基金投资组合报告（未经审计）”和“十一、基金的业绩”两项内容，有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日（未经审计）。
- 6、在“第二十一部分 其他应披露事项”部分，增加了本基金及本基金管理人的相应披露事项。

圆信永丰基金管理有限公司

二〇一六年十二月十二日