

# 圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金

## 2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人:圆信永丰基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 28 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月29日（基金合同生效日）起至2018年06月30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 主要财务指标和基金净值表现                        | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| §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             | 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             | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11 |
| 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       | 11 |
| §5 托管人报告                                | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 11 |
| 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 | 12 |
| 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     | 12 |
| §6 半年度财务会计报告(未经审计)                      | 12 |
| 6.1 资产负债表                               | 12 |
| 6.2 利润表                                 | 14 |
| 6.3 所有者权益(基金净值)变动表                      | 15 |
| 6.4 报表附注                                | 16 |
| §7 投资组合报告                               | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 41 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 41 |
| 7.3 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       | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 44 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 46 |
| 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      | 47 |
| 7.7 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   | 47 |
| 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   | 47 |
| 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      | 47 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 47 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 48 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 48 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 49 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 49 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 49 |

|   |    |
|---|----|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....   | 49 |
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 49 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 50 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 50 |
| 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.....   | 50 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 50 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 50 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 50 |
| 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.....      | 50 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 50 |
| 10.8 其他重大事件.....                        | 53 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 55 |
| 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..... | 55 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 55 |
| §12 备查文件目录.....                         | 55 |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 55 |
| 12.2 存放地点.....                          | 55 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 55 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金名称       | 圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 圆信永丰优悦生活          |
| 基金主代码      | 004959            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日    | 2018年01月29日       |
| 基金管理人      | 圆信永丰基金管理有限公司      |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司      |
| 报告期末基金份额总额 | 2,103,821,008.13份 |
| 基金合同存续期    | 不定期               |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金通过投资于优悦生活主题产业和行业中的标的，在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，为基金持有人创造良好的投资回报。  |
| 投资策略   | 本基金通过对国家宏观经济政策的深入分析，在动态跟踪财政政策、货币政策的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响和预期收益风险，评估股票、债券等大类资产的估值水平和投资价值，确定投资组合的资产配置比例，并适时进行调整。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×35%  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

|        |      |  |                     |
|--------|------|--|---------------------|
| 露负责人   | 联系电话 | 021-60366000                                       | 010-66105798        |
|        | 电子邮箱 | service@gtsfund.com.cn                             | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 |      | 4006070088   | 95588               |
| 传真     |      | 021-60366006                                       | 010-66105799        |
| 注册地址   |      | 中国（福建）自由贸易试验区<br>厦门片区（保税港区）海景南<br>二路45号4楼402单元之175 | 北京市西城区复兴门内大街5<br>5号 |
| 办公地址   |      | 上海市浦东新区世纪大道152<br>8号陆家嘴基金大厦19楼                     | 北京市西城区复兴门内大街5<br>5号 |
| 邮政编码   |      | 200122   | 100140              |
| 法定代表人  |      | 洪文瑾  | 易会满                 |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                            |
|----------------------|----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 上海证券报                      |
| 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 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                       |
|--------|--------------|----------------------------|
| 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（2018年01月29日（基金合同生效日）- 2018年06月30日） |
| 本期已实现收益       | 63,688,746.48                          |

|                      |                   |
|----------------------|-------------------|
| 本期利润                 | -105,270,028.76   |
| 加权平均基金份额本期利润         | -0.0461           |
| 本期加权平均净值利润率          | -4.61%            |
| 本期基金份额净值增长率          | -4.95%            |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期末（2018年06月30日） |
| 期末可供分配利润             | -104,232,568.85   |
| 期末可供分配基金份额利润         | -0.0495           |
| 期末基金资产净值             | 1,999,588,439.28  |
| 期末基金份额净值             | 0.9505            |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 报告期末（2018年06月30日） |
| 基金份额累计净值增长率          | -4.95%            |

注1：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

注3：本期指2018年1月29日至2018年6月30日，上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

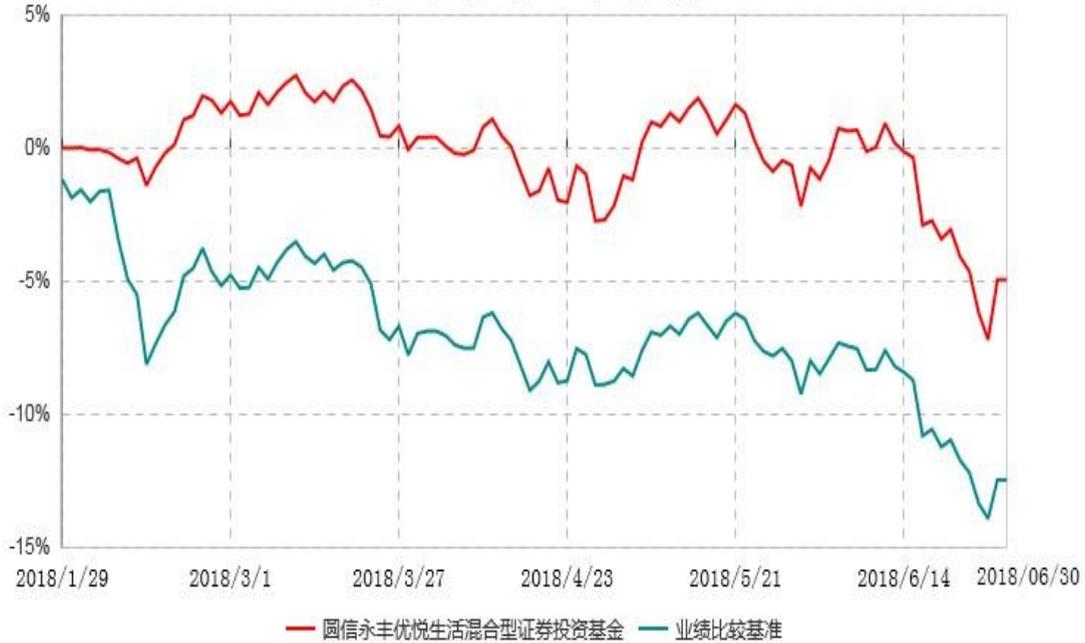
## 3.2 基金净值表现

### 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      | -4.25%   | 1.04%       | -4.86%     | 0.83%         | 0.61% | 0.21%  |
| 过去三个月      | -5.35%   | 0.88%       | -6.00%     | 0.74%         | 0.65% | 0.14%  |
| 自基金合同生效起至今 | -4.95%   | 0.74%       | -12.47%    | 0.79%         | 7.52% | -0.05% |

### 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

圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年01月29日-2018年06月30日)



注：自基金合同生效后，截止报告期末，本基金成立不满一年且尚处于建仓期。

## § 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2018年6月30日，公司旗下共管理十五只开放式基金产品，包括一只股票型基金、八只混合型基金、五只债券型基金和一只货币市场基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 |     | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-----------------|-----|--------|----|
|    |    | 任职日期            | 离任日 |        |    |
|    |    |                 |     |        |    |

|     |         |            | 期 |     |   |
|-----|---------|------------|---|-----|---|
| 范妍  | 本基金基金经理 | 2018-01-29 | - | 10年 | 复旦大学管理学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设权益投资部总监。历任兴业证券研究中心助理策略分析师、安信证券研究中心高级策略分析师、工银瑞信基金策略研究员、圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设权益投资部副总监。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格证。 |
| 肖世源 | 本基金基金经理 | 2018-01-29 | - | 7年  | 复旦大学中西医结合临床硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司基金投资部下设权益投资部基金经理。历任上海合懿投资管理合伙企业（有限合伙）投研部研究员，上海呈瑞投资管理有限公司投研部研究员，圆信永丰基金管理有限公司研究部研究员。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格证。    |

注1：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

注2：范妍、肖世源的“任职日期”为基金合同生效之日。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、该基金基金合同的规定。基金经理对个券和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

5月下旬至6月份，该基金进行了一定的减仓动作。配置上规避之前涨幅较大避险板块——医药和食品，配置以白马股为底仓，弹性仓位增加了原油、棉花、钢铁、水泥、电解铝、锡、鸡等供应偏紧的周期类板块。金融类行业中，相对看好银行和保险。消费类行业中，配置以白酒、家电、家具等行业为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末圆信永丰优悦生活基金份额净值为0.9505元，本报告期内，基金份额净值增长率为-4.95%，同期业绩比较基准收益率为-12.47%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

6、7月份的经济数据逐步出现了一定走弱的迹象，消费数据体现的最为明显。而贸易战和去杠杆的影响在不断显性化，时间维度越长，能见度越低。由于我国部分农产品、

原油等基础大宗商品对外依存度较高，贸易摩擦可能会带来通货膨胀在下半年逐步走高。

按照以往的经验，宽信用通常对应股市底部，例如2005年年中、2008年年底以及2014年年中。因此，我们判断估值的底部可能已经出现，但由于此轮企业盈利在不确定的宏观环境中可能继续下行，EPS的底部可能还没有看到。配置上，我们集中于必需消费品、通货膨胀受益行业和大金融板块。

#### 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、清算登记部分管领导、研究部总监、监察稽核部总监、清算登记部总监和基金会计主管组成。估值委员会负责组织制定、评估和适时修订基金估值政策和程序，并指导和监督整个估值流程。估值委员会成员包括基金核算、行业研究等方面的业务骨干，均具有基金从业资格、专业胜任能力和丰富的工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理不属于公司估值委员会成员，不介入基金日常估值业务。

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

#### 4.7 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

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

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

本报告期内，本基金的管理人——圆信永丰基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，本基金未进行利润分配。

## 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本基金2018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：圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2018年06月30日 |
|------------|---------|--------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 41,197,440.40      |
| 结算备付金      |         | 19,134,926.67      |
| 存出保证金      |         | 602,645.44         |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 1,580,546,822.06   |
| 其中：股票投资    |         | 1,424,146,422.06   |
| 基金投资       |         | -                  |
| 债券投资       |         | 156,400,400.00     |
| 资产支持证券投资   |         | -                  |
| 贵金属投资      |         | -                  |

|                 |            |                            |
|-----------------|------------|----------------------------|
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                          |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 396,000,000.00             |
| 应收证券清算款         |            | -                          |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 2,461,520.94               |
| 应收股利            |            | -                          |
| 应收申购款           |            | 37,395.53                  |
| 递延所得税资产         |            | -                          |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                          |
| 资产总计            |            | 2,039,980,751.04           |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018年06月30日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                            |
| 短期借款            |            | -                          |
| 交易性金融负债         |            | -                          |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                          |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                          |
| 应付证券清算款         |            | 22,812,375.35              |
| 应付赎回款           |            | 11,481,640.99              |
| 应付管理人报酬         |            | 2,598,528.75               |
| 应付托管费           |            | 346,470.52                 |
| 应付销售服务费         |            | -                          |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 3,024,929.76               |
| 应交税费            |            | -                          |
| 应付利息            |            | -                          |
| 应付利润            |            | -                          |
| 递延所得税负债         |            | -                          |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 128,366.39                 |
| 负债合计            |            | 40,392,311.76              |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 2,103,821,008.13           |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | -104,232,568.85            |

|            |  |                  |
|------------|--|------------------|
| 所有者权益合计    |  | 1,999,588,439.28 |
| 负债和所有者权益总计 |  | 2,039,980,751.04 |

注1：本基金合同生效日为2018年1月29日，2018年半年度实际报告期间为2018年1月29日至2018年6月30日。截至报告期末，本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

注2：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.9505元，基金份额总额2,103,821,008.13份。

## 6.2 利润表

会计主体：圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月29日（基金合同生效日）至2018年06月30日

单位：人民币元

| 项目                   | 附注号        | 本期2018年01月29日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |
|----------------------|------------|------------------------------------|
| 一、收入                 |            | -84,619,063.76                     |
| 1. 利息收入              |            | 19,001,879.07                      |
| 其中：存款利息收入            | 6.4.7.11   | 9,030,876.42                       |
| 债券利息收入               |            | 1,640,495.27                       |
| 资产支持证券利息收入           |            | -                                  |
| 买入返售金融资产收入           |            | 8,330,507.38                       |
| 其他利息收入               |            | -                                  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）    |            | 64,536,043.48                      |
| 其中：股票投资收益            | 6.4.7.12   | 48,240,355.96                      |
| 基金投资收益               | 6.4.7.13   | -                                  |
| 债券投资收益               | 6.4.7.14   | 86,336.20                          |
| 资产支持证券投资收益           | 6.4.7.14.5 | -                                  |
| 贵金属投资收益              | 6.4.7.15   | -                                  |
| 衍生工具收益               | 6.4.7.16   | -                                  |
| 股利收益                 | 6.4.7.17   | 16,209,351.32                      |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填 | 6.4.7.18   | -168,958,775.24                    |

|                             |            |                 |
|-----------------------------|------------|-----------------|
| 列)                          |            |                 |
| 4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)         |            | -               |
| 5. 其他收入 (损失以“-”号填列)         | 6.4.7.19   | 801,788.93      |
| <b>减: 二、费用</b>              |            | 20,650,965.00   |
| 1. 管理人报酬                    | 6.4.10.2.1 | 14,260,073.58   |
| 2. 托管费                      | 6.4.10.2.2 | 1,901,343.19    |
| 3. 销售服务费                    | 6.4.10.2.3 | -               |
| 4. 交易费用                     | 6.4.7.20   | 4,386,899.83    |
| 5. 利息支出                     |            | -               |
| 其中: 卖出回购金融资产支出              |            | -               |
| 6. 税金及附加                    |            | -               |
| 7. 其他费用                     | 6.4.7.21   | 102,648.40      |
| <b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b> |            | -105,270,028.76 |
| 减: 所得税费用                    |            | -               |
| <b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>   |            | -105,270,028.76 |

注: 本基金合同生效日为2018年1月29日, 2018年半年度实际报告期间为2018年1月29日至2018年6月30日。截至报告期末, 本基金合同生效未满一年, 本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金

本报告期: 2018年01月29日 (基金合同生效日) 至2018年06月30日

单位: 人民币元

| 项 目                       | 本期                                 |                 |                  |
|---------------------------|------------------------------------|-----------------|------------------|
|                           | 2018年01月29日 (基金合同生效日) 至2018年06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)          | 2,373,095,869.57                   | -               | 2,373,095,869.57 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | -                                  | -105,270,028.76 | -105,270,028.76  |

|  |                  |                 |                  |
|--|------------------|-----------------|------------------|
| 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)      | -269,274,861.44  | 1,037,459.91    | -268,237,401.53  |
| 其中: 1. 基金申购款                           | 4,427,905.95     | -35,054.26      | 4,392,851.69     |
| 2. 基金赎回款                               | -273,702,767.39  | 1,072,514.17    | -272,630,253.22  |
| 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)                        | 2,103,821,008.13 | -104,232,568.85 | 1,999,588,439.28 |

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

刘雪峰

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]第1058号《关于准予圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金注册的批复》核准,由圆信永丰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,372,682,850.13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(2018)第0063号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金合同》于2018年1月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,373,095,869.57份基金份额,其中认购资金利息折合413,019.44份基金份额。本基金的基金管理人为圆信永丰基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、中小企业私募债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的40%-80%。投资于优悦生活主题相关的证券比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×35%。

#### 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》、《圆信永丰优悦生活混合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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月29日(基金合同生效日)至2018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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月29日(基金合同生效日)至2018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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年6月30日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 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其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，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) 于2017年12月29日前，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的初始投资成本，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。自2017年12月29日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中央国债登记结算有限责任公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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) 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。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2018年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 41,197,440.40      |
| 定期存款         | -                  |
| 其中：存款期限1个月以内 | -                  |
| 存款期限1-3个月    | -                  |
| 存款期限3个月以上    | -                  |
| 其他存款         | -                  |
| 合计           | 41,197,440.40      |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末2018年06月30日   |                  |                 |            |
|---------------|------------------|------------------|-----------------|------------|
|               | 成本               | 公允价值             | 公允价值变动          |            |
| 股票            | 1,593,616,249.30 | 1,424,146,422.06 | -169,469,827.24 |            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                | -                | -               |            |
| 债券            | 交易所市场            | -                | -               |            |
|               | 银行间市场            | 155,889,348.00   | 156,400,400.00  | 511,052.00 |
|               | 合计               | 155,889,348.00   | 156,400,400.00  | 511,052.00 |
| 资产支持证券        | -                | -                | -               |            |
| 基金            | -                | -                | -               |            |
| 其他            | -                | -                | -               |            |
| 合计            | 1,749,505,597.30 | 1,580,546,822.06 | -168,958,775.24 |            |

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

报告期末本基金未持有衍生金融工具。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 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2018年06月30日 |           |
|-------|----------------|-----------|
|       | 账面余额           | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 396,000,000.00 | -         |
| 银行间市场 | -              | -         |
| 合计    | 396,000,000.00 | -         |

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

报告期末本基金未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2018年06月30日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 4,950.35           |
| 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  | 7,749.63           |
| 应收债券利息     | 2,254,337.95       |
| 应收资产支持证券利息 | -                  |
| 应收买入返售证券利息 | 194,238.93         |
| 应收申购款利息    | -                  |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                  |
| 其他         | 244.08             |
| 合计         | 2,461,520.94       |

**6.4.7.6 其他资产**

报告期末本基金未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 3,024,430.27       |
| 银行间市场应付交易费用 | 499.49             |
| 合计          | 3,024,929.76       |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 28,842.87          |
| 预提费用        | 99,523.52          |
| 合计          | 128,366.39         |

注：此处应付赎回费含应付转出费。

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期2018年01月29日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |                  |
|---------------|------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                            | 账面金额             |
| 基金合同生效日       | 2,373,095,869.57                   | 2,373,095,869.57 |
| 本期申购          | 4,427,905.95                       | 4,427,905.95     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -273,702,767.39                    | -273,702,767.39  |
| 本期末           | 2,103,821,008.13                   | 2,103,821,008.13 |

注1：申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

注2：本基金自2017年12月27日至2018年1月24日止期间公开发售，共募集有效净认购资

金人民币2,372,682,850.13元。根据《圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币413,019.44元在本基金成立后,折算为413,019.44份基金份额,划入基金份额持有人账户。

注3:根据《圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金于2018年1月29日(基金合同生效日)至2018年3月29日止期间暂不向投资人开放基金交易。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|---------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日        | -             | -               | -               |
| 本期利润           | 63,688,746.48 | -168,958,775.24 | -105,270,028.76 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -5,383,850.73 | 6,421,310.64    | 1,037,459.91    |
| 其中:基金申购款       | 90,860.04     | -125,914.30     | -35,054.26      |
| 基金赎回款          | -5,474,710.77 | 6,547,224.94    | 1,072,514.17    |
| 本期已分配利润        | -             | -               | -               |
| 本期末            | 58,304,895.75 | -162,537,464.60 | -104,232,568.85 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

| 项目        | 本期2018年01月29日(基金合同生效日)至2018年06月30日 |
|-----------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 534,004.40                         |
| 定期存款利息收入  | 8,259,694.44                       |
| 其他存款利息收入  | -                                  |
| 结算备付金利息收入 | 234,738.81                         |
| 其他        | 2,438.77                           |
| 合计        | 9,030,876.42                       |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2018年01月29日(基金合同生效日)至2018年06月30 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|            | 日                |
|------------|------------------|
| 卖出股票成交总额   | 1,040,031,743.60 |
| 减：卖出股票成本总额 | 991,791,387.64   |
| 买卖股票差价收入   | 48,240,355.96    |

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2018年01月29日（基金合同生效日）至2018年<br>06月30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 | 86,336.20                                  |
| 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                            | 86,336.20                                  |

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2018年01月29日（基金合同生效日）至2018年06月30<br>日 |
|-------------------------|--|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 104,164,683.20                             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 101,242,663.80                             |
| 减：应收利息总额                | 2,835,683.20                               |
| 买卖债券差价收入                | 86,336.20                                  |

##### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

**6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

**6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

**6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

根据基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

**6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

根据基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

**6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

根据基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

**6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

根据基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

**6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2018年01月29日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |
|-------------|--|
| 股票投资产生的股利收益 | 16,209,351.32                          |

|             |               |
|-------------|---------------|
| 基金投资产生的股利收益 | -             |
| 合计          | 16,209,351.32 |

## 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2018年01月29日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |
|------------------------|--|
| 1. 交易性金融资产             | -168,958,775.24                        |
| ——股票投资                 | -169,469,827.24                        |
| ——债券投资                 | 511,052.00                             |
| ——资产支持证券投资             | -                                      |
| ——基金投资                 | -                                      |
| ——贵金属投资                | -                                      |
| ——其他                   | -                                      |
| 2. 衍生工具                | -                                      |
| ——权证投资                 | -                                      |
| 3. 其他                  | -                                      |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                                      |
| 合计                     | -168,958,775.24                        |

## 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2018年01月29日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |
|---------|--|
| 基金赎回费收入 | 800,456.73                             |
| 转换费收入   | 1,332.20                               |
| 合计      | 801,788.93                             |

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。

注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，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.20 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年01月29日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | 4,385,879.83                           |
| 银行间市场交易费用 | 1,020.00                               |
| 合计        | 4,386,899.83                           |

**6.4.7.21 其他费用**

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2018年01月29日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |
|--------|--|
| 审计费用   | 45,238.24                              |
| 信息披露费  | 54,285.28                              |
| 股东卡开户费 | 400.00                                 |
| 汇划手续费  | 2,724.88                               |
| 合计     | 102,648.40                             |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表报出日，本基金并无需作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截止财务报表报出日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 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**

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

**6.4.9.2 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 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）   | 基金托管人、基金销售机构        |
| 厦门国际信托有限公司               | 基金管理人的股东            |
| 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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年01月29日（基金合同生效日）至2018年06<br>月30日 |
|----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 14,260,073.58                              |

|                 |              |
|-----------------|--------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 7,558,099.81 |
|-----------------|--------------|

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               |
|----------------|----------------------------------|
|                | 2018年01月29日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,901,343.19                     |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期内无基金管理人运用固有基金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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                               |            |
|--------------|----------------------------------|------------|
|              | 2018年01月29日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |            |
|              | 期末余额                             | 当期利息收入     |
| 中国工商银行股份有限公司 | 41,197,440.40                    | 534,004.40 |

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金**

本基金本报告期内无利润分配。

**6.4.12 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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

| 6.4.12.1.1 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 |
| 603693               | 江苏新能 | 2018-06-25 | 2018-07-03 | 新股未上市  | 9.00  | 9.00   | 5,384    | 48,456.00 | 48,456.00 | -  |
| 603706               | 东方环宇 | 2018-06-29 | 2018-07-09 | 新股未上市  | 13.09 | 13.09  | 1,765    | 23,103.85 | 23,103.85 | -  |
| 603105               | 芯能科技 | 2018-06-29 | 2018-07-09 | 新股未上市  | 4.83  | 4.83   | 3,410    | 16,470.30 | 16,470.30 | -  |

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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一部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规性实行全面监督重点反馈的第四道防线，风险管理委员会对公司经营和基金作中的风险进行严格的合规检查和风险控制评估后反馈董事会。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

##### 6.4.13.2 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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本期末未持有资产支持证券。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2018年06月30日 |
|--------|--------------------|
| AAA    | -                  |
| AAA以下  | -                  |
| 未评级    | 107,905,400.00     |
| 合计     | 107,905,400.00     |

注1：评级数据取自第三方评级机构的债项评级截至报告期末最新数据。

注2：未评级部分为债券期限大于一年的国债、政策性金融债。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本期末未持有资产支持证券。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2018年06月30日 |
|--------|--------------------|
| AAA    | 48,495,000.00      |
| AAA以下  | -                  |
| 未评级    | -                  |
| 合计     | 48,495,000.00      |

注1：评级数据取自第三方评级机构的主体评级截至报告期末最新数据。

注2：同业存单以主体评级列示。

### 6.4.13.3 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，有效保障基金持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

于2018年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

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

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

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末2018年06月<br>30日 | 1年以内           | 1-5年 | 5年以上 | 不计息              | 合计               |
|--------------------|----------------|------|------|------------------|------------------|
| 资产                 |                |      |      |                  |                  |
| 银行存款               | 41,197,440.40  | -    | -    | -                | 41,197,440.40    |
| 结算备付金              | 19,134,926.67  | -    | -    | -                | 19,134,926.67    |
| 存出保证金              | 602,645.44     | -    | -    | -                | 602,645.44       |
| 交易性金融资产            | 156,400,400.00 | -    | -    | 1,424,146,422.06 | 1,580,546,822.06 |

|          |                |   |   |                  |                  |
|----------|----------------|---|---|------------------|------------------|
| 买入返售金融资产 | 396,000,000.00 | - | - | -                | 396,000,000.00   |
| 应收利息     | -              | - | - | 2,461,520.94     | 2,461,520.94     |
| 应收申购款    | -              | - | - | 37,395.53        | 37,395.53        |
| 资产总计     | 613,335,412.51 | - | - | 1,426,645,338.53 | 2,039,980,751.04 |
| 负债       |                |   |   |                  |                  |
| 应付证券清算款  | -              | - | - | 22,812,375.35    | 22,812,375.35    |
| 应付赎回款    | -              | - | - | 11,481,640.99    | 11,481,640.99    |
| 应付管理人报酬  | -              | - | - | 2,598,528.75     | 2,598,528.75     |
| 应付托管费    | -              | - | - | 346,470.52       | 346,470.52       |
| 应付交易费用   | -              | - | - | 3,024,929.76     | 3,024,929.76     |
| 其他负债     | -              | - | - | 128,366.39       | 128,366.39       |
| 负债总计     | -              | - | - | 40,392,311.76    | 40,392,311.76    |
| 利率敏感度缺口  | 613,335,412.51 | - | - | 1,386,253,026.77 | 1,999,588,439.28 |

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2018年06月30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7.82%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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，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。

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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018年06月30日 |              |
|---------------|--------------------|--------------|
|               | 公允价值               | 占基金资产净值比例(%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 1,424,146,422.06   | 71.22        |
| 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            | 1,424,146,422.06   | 71.22        |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准(附注6.4.1)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：人民币元) |
|    |                               | 本期末<br>2018年06月30日          |
|    | 1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%        | 82,830,000.00               |
|    | 2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%        | -82,830,000.00              |

注1：本基金管理人运用资本-资产定价模型对本基金市场价格风险进行分析，上表为市场价格风险的敏感性分析。在假设影响基金资产公允价值的其他风险变量不变的前提下，通过构造给定市场指数上涨或下跌一定比例的情景，分析组合权益类资产价格风险

的敏感性。

注2：金额为约数，精确到万元。

#### 6.4.14 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2018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1,424,058,391.91元，属于第二层次的余额为156,488,430.15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2018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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税

应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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              | 1,424,146,422.06 | 69.81         |
|    | 其中：股票             | 1,424,146,422.06 | 69.81         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 156,400,400.00   | 7.67          |
|    | 其中：债券             | 156,400,400.00   | 7.67          |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | 396,000,000.00   | 19.41         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 60,332,367.07    | 2.96          |
| 8  | 其他各项资产            | 3,101,561.91     | 0.15          |
| 9  | 合计                | 2,039,980,751.04 | 100.00        |

### 7.2 报告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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|---------|---------------|
|----|------|---------|---------------|

|   |                  |                  |       |
|---|------------------|------------------|-------|
| A | 农、林、牧、渔业         | 32,802,378.61    | 1.64  |
| B | 采矿业              | 82,250,735.75    | 4.11  |
| C | 制造业              | 886,319,706.60   | 44.33 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 71,559.85        | 0.00  |
| E | 建筑业              | -                | -     |
| F | 批发和零售业           | -                | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 868,610.00       | 0.04  |
| H | 住宿和餐饮业           | -                | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 39,500,000.00    | 1.98  |
| J | 金融业              | 224,027,081.32   | 11.20 |
| K | 房地产业             | 139,141,003.80   | 6.96  |
| L | 租赁和商务服务业         | -                | -     |
| M | 科学研究和技术服务业       | -                | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 81,226.14        | 0.00  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -     |
| P | 教育               | -                | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | 19,084,119.99    | 0.95  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -                | -     |
| S | 综合               | -                | -     |
|   | 合计               | 1,424,146,422.06 | 71.22 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 000858 | 五粮液  | 1,121,006 | 85,196,456.00 | 4.26         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 99,934    | 73,097,723.64 | 3.66         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 3  | 000651 | 格力电器 | 1,506,000 | 71,007,900.00 | 3.55 |
| 4  | 600048 | 保利地产 | 5,710,000 | 69,662,000.00 | 3.48 |
| 5  | 600703 | 三安光电 | 3,605,464 | 69,297,018.08 | 3.47 |
| 6  | 000002 | 万科A  | 2,810,428 | 69,136,528.80 | 3.46 |
| 7  | 601318 | 中国平安 | 1,121,449 | 65,694,482.42 | 3.29 |
| 8  | 002236 | 大华股份 | 2,911,951 | 65,664,495.05 | 3.28 |
| 9  | 601601 | 中国太保 | 2,000,334 | 63,710,637.90 | 3.19 |
| 10 | 601336 | 新华保险 | 1,297,825 | 55,650,736.00 | 2.78 |
| 11 | 002042 | 华孚时尚 | 7,025,892 | 52,272,636.48 | 2.61 |
| 12 | 002572 | 索菲亚  | 1,605,027 | 51,649,768.86 | 2.58 |
| 13 | 600028 | 中国石化 | 7,000,085 | 45,430,551.65 | 2.27 |
| 14 | 002202 | 金风科技 | 3,376,028 | 42,672,993.92 | 2.13 |
| 15 | 002583 | 海能达  | 5,000,072 | 41,750,601.20 | 2.09 |
| 16 | 600585 | 海螺水泥 | 1,201,597 | 40,229,467.56 | 2.01 |
| 17 | 600406 | 国电南瑞 | 2,500,000 | 39,500,000.00 | 1.98 |
| 18 | 601939 | 建设银行 | 5,713,000 | 37,420,150.00 | 1.87 |
| 19 | 600583 | 海油工程 | 7,000,035 | 36,820,184.10 | 1.84 |
| 20 | 000933 | 神火股份 | 7,200,000 | 34,632,000.00 | 1.73 |
| 21 | 600019 | 宝钢股份 | 4,227,992 | 32,936,057.68 | 1.65 |
| 22 | 002594 | 比亚迪  | 606,879   | 28,935,990.72 | 1.45 |
| 23 | 002179 | 中航光电 | 706,554   | 27,555,606.00 | 1.38 |
| 24 | 600038 | 中直股份 | 674,416   | 26,969,895.84 | 1.35 |
| 25 | 600803 | 新奥股份 | 2,200,060 | 25,388,692.40 | 1.27 |
| 26 | 002222 | 福晶科技 | 1,900,003 | 24,776,039.12 | 1.24 |
| 27 | 000960 | 锡业股份 | 1,799,987 | 21,617,843.87 | 1.08 |
| 28 | 600066 | 宇通客车 | 1,118,904 | 21,471,767.76 | 1.07 |
| 29 | 300244 | 迪安诊断 | 1,003,899 | 19,084,119.99 | 0.95 |
| 30 | 000998 | 隆平高科 | 1,000,000 | 18,860,000.00 | 0.94 |
| 31 | 600535 | 天士力  | 699,924   | 18,072,037.68 | 0.90 |
| 32 | 600690 | 青岛海尔 | 800,000   | 15,408,000.00 | 0.77 |
| 33 | 600557 | 康缘药业 | 1,200,000 | 14,820,000.00 | 0.74 |

|    |        |      |         |               |      |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 34 | 002299 | 圣农发展 | 900,089 | 13,942,378.61 | 0.70 |
| 35 | 000001 | 平安银行 | 75,000  | 681,750.00    | 0.03 |
| 36 | 603338 | 浙江鼎力 | 9,400   | 436,160.00    | 0.02 |
| 37 | 601111 | 中国国航 | 44,000  | 391,160.00    | 0.02 |
| 38 | 601288 | 农业银行 | 105,000 | 361,200.00    | 0.02 |
| 39 | 600340 | 华夏幸福 | 13,300  | 342,475.00    | 0.02 |
| 40 | 601688 | 华泰证券 | 19,000  | 284,430.00    | 0.01 |
| 41 | 600029 | 南方航空 | 33,000  | 278,850.00    | 0.01 |
| 42 | 600031 | 三一重工 | 30,000  | 269,100.00    | 0.01 |
| 43 | 600030 | 中信证券 | 13,500  | 223,695.00    | 0.01 |
| 44 | 600115 | 东方航空 | 30,000  | 198,600.00    | 0.01 |
| 45 | 300747 | 锐科激光 | 1,543   | 123,995.48    | 0.01 |
| 46 | 601330 | 绿色动力 | 4,971   | 81,226.14     | 0.00 |
| 47 | 603650 | 彤程新材 | 2,376   | 50,988.96     | 0.00 |
| 48 | 603693 | 江苏新能 | 5,384   | 48,456.00     | 0.00 |
| 49 | 603706 | 东方环宇 | 1,765   | 23,103.85     | 0.00 |
| 50 | 603105 | 芯能科技 | 3,410   | 16,470.30     | 0.00 |

## 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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额       | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 000858 | 五粮液  | 119,978,587.87 | 6.00           |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 92,193,998.01  | 4.61           |
| 3  | 601601 | 中国太保 | 82,389,329.05  | 4.12           |
| 4  | 000002 | 万科A  | 81,978,847.50  | 4.10           |
| 5  | 600703 | 三安光电 | 81,964,764.80  | 4.10           |
| 6  | 000651 | 格力电器 | 81,532,808.50  | 4.08           |
| 7  | 002236 | 大华股份 | 79,430,296.26  | 3.97           |
| 8  | 600048 | 保利地产 | 74,860,281.60  | 3.74           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 9  | 601336 | 新华保险 | 73,796,678.50 | 3.69 |
| 10 | 600029 | 南方航空 | 72,022,642.59 | 3.60 |
| 11 | 600519 | 贵州茅台 | 69,846,950.78 | 3.49 |
| 12 | 002042 | 华孚时尚 | 61,270,910.02 | 3.06 |
| 13 | 600028 | 中国石化 | 61,270,723.59 | 3.06 |
| 14 | 600038 | 中直股份 | 59,576,943.32 | 2.98 |
| 15 | 002572 | 索菲亚  | 56,332,868.81 | 2.82 |
| 16 | 002583 | 海能达  | 56,257,490.51 | 2.81 |
| 17 | 002343 | 慈文传媒 | 54,938,911.55 | 2.75 |
| 18 | 000513 | 丽珠集团 | 53,241,548.61 | 2.66 |
| 19 | 000960 | 锡业股份 | 53,102,424.26 | 2.66 |
| 20 | 002202 | 金风科技 | 51,921,374.78 | 2.60 |
| 21 | 000933 | 神火股份 | 48,740,597.00 | 2.44 |
| 22 | 600521 | 华海药业 | 47,714,938.39 | 2.39 |
| 23 | 600011 | 华能国际 | 45,902,089.52 | 2.30 |
| 24 | 601939 | 建设银行 | 43,359,524.80 | 2.17 |
| 25 | 002179 | 中航光电 | 42,581,812.60 | 2.13 |
| 26 | 600406 | 国电南瑞 | 42,307,466.00 | 2.12 |
| 27 | 600583 | 海油工程 | 41,173,226.39 | 2.06 |
| 28 | 600019 | 宝钢股份 | 40,830,062.98 | 2.04 |
| 29 | 600585 | 海螺水泥 | 40,775,836.34 | 2.04 |
| 30 | 600340 | 华夏幸福 | 40,471,008.63 | 2.02 |
| 31 | 600660 | 福耀玻璃 | 40,306,238.83 | 2.02 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600029 | 南方航空 | 68,260,236.33 | 3.41           |
| 2  | 000513 | 丽珠集团 | 58,435,177.88 | 2.92           |
| 3  | 600521 | 华海药业 | 51,287,882.99 | 2.56           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 4  | 002343 | 慈文传媒 | 49,360,780.61 | 2.47 |
| 5  | 600660 | 福耀玻璃 | 43,570,962.41 | 2.18 |
| 6  | 600011 | 华能国际 | 42,530,712.22 | 2.13 |
| 7  | 600038 | 中直股份 | 39,825,568.50 | 1.99 |
| 8  | 000858 | 五粮液  | 39,411,870.08 | 1.97 |
| 9  | 002511 | 中顺洁柔 | 39,355,664.61 | 1.97 |
| 10 | 000039 | 中集集团 | 38,878,886.36 | 1.94 |
| 11 | 600340 | 华夏幸福 | 35,537,649.66 | 1.78 |
| 12 | 002648 | 卫星石化 | 33,743,238.62 | 1.69 |
| 13 | 600809 | 山西汾酒 | 32,086,761.84 | 1.60 |
| 14 | 000710 | 贝瑞基因 | 29,364,922.36 | 1.47 |
| 15 | 000960 | 锡业股份 | 29,222,691.39 | 1.46 |
| 16 | 600998 | 九州通  | 27,957,821.24 | 1.40 |
| 17 | 002299 | 圣农发展 | 27,950,858.29 | 1.40 |
| 18 | 603899 | 晨光文具 | 26,059,423.10 | 1.30 |
| 19 | 002353 | 杰瑞股份 | 25,819,350.85 | 1.29 |
| 20 | 603515 | 欧普照明 | 23,800,490.41 | 1.19 |

#### 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 | 2,585,407,636.94 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,040,031,743.60 |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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 | 107,905,400.00 | 5.40         |

|    |           |                |      |
|----|-----------|----------------|------|
|    | 其中：政策性金融债 | 107,905,400.00 | 5.40 |
| 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      | 48,495,000.00  | 2.43 |
| 9  | 其他        | -              | -    |
| 10 | 合计        | 156,400,400.00 | 7.82 |

### 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  | 111805070 | 18建设银行CD070 | 500,000 | 48,495,000.00 | 2.43         |
| 2  | 150418    | 15农发18      | 300,000 | 30,009,000.00 | 1.50         |
| 3  | 160301    | 16进出01      | 300,000 | 29,838,000.00 | 1.49         |
| 4  | 140209    | 14国开09      | 200,000 | 20,266,000.00 | 1.01         |
| 5  | 160208    | 16国开08      | 200,000 | 19,866,000.00 | 0.99         |

### 7.7 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

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

根据基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

### 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

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同约定，本基金不参与国债期货投资。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据基金合同约定，本基金不参与国债期货投资。

#### 7.11.3 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投资。

### 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 本基金投资前十名股票中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   | 602,645.44   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,461,520.94 |
| 5  | 应收申购款   | 37,395.53    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,101,561.91 |

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

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**

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

**7.12.6 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。

**§ 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<br>户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份<br>额 | 持有人结构         |            |                  |            |
|------------------|-------------------|---------------|------------|------------------|------------|
|                  |                   | 机构投资者         |            | 个人投资者            |            |
|                  |                   | 持有份额          | 占总份<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 21,315           | 98,701.43         | 11,279,796.85 | 0.54%      | 2,092,541,211.28 | 99.46%     |

**8.2 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 | 149,611.69 | 0.01%    |

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2018年01月29日)基金份额总额 | 2,373,095,869.57 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额      | 4,427,905.95     |

|                         |                  |
|-------------------------|------------------|
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 273,702,767.39   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额            | 2,103,821,008.13 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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。

### 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及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|                |   |                |        |            |        |   |
|----------------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 证券             |   |                |        |            |        |   |
| 华泰<br>证券       | 1 | 140,868,444.53 | 3.89%  | 103,016.98 | 3.41%  | - |
| 招商<br>证券       | 2 | 412,392,810.64 | 11.38% | 384,062.29 | 12.70% | - |
| 东方<br>证券       | 2 | 783,729,617.16 | 21.64% | 573,141.63 | 18.95% | - |
| 国信<br>证券       | 2 | -              | -      | -          | -      | - |
| 国泰<br>君安       | 2 | 105,330,384.95 | 2.91%  | 98,094.85  | 3.24%  | - |
| 天风<br>证券       | 2 | 268,432,237.97 | 7.41%  | 196,303.28 | 6.49%  | - |
| 中泰<br>证券       | 2 | -              | -      | -          | -      | - |
| 中金<br>公司       | 2 | 159,914,208.68 | 4.41%  | 148,928.12 | 4.92%  | - |
| 中信<br>证券       | 2 | 173,959,876.51 | 4.80%  | 162,010.52 | 5.36%  | - |
| 中信<br>建投       | 2 | 134,389,646.15 | 3.71%  | 125,156.77 | 4.14%  | - |
| 东吴<br>证券       | 2 | 98,326,720.47  | 2.71%  | 71,906.02  | 2.38%  | - |
| 兴业<br>证券       | 2 | 192,657,396.89 | 5.32%  | 179,422.08 | 5.93%  | - |
| 申万<br>宏源<br>证券 | 2 | 223,541,390.53 | 6.17%  | 208,184.78 | 6.88%  | - |
| 海通<br>证券       | 2 | 213,848,508.49 | 5.90%  | 199,156.07 | 6.58%  | - |
| 华福<br>证券       | 2 | -              | -      | -          | -      | - |
| 安信             | 2 | 261,050,344.12 | 7.21%  | 243,119.28 | 8.04%  | - |

|      |   |                |        |            |        |   |
|------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 证券   |   |                |        |            |        |   |
| 平安证券 | 2 | -              | -      | -          | -      | - |
| 东兴证券 | 2 | -              | -      | -          | -      | - |
| 西部证券 | 2 | -              | -      | -          | -      | - |
| 国金证券 | 2 | 453,887,240.82 | 12.53% | 331,927.60 | 10.97% | - |

## 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 |              | 基金交易 |              |
|--------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|        | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 浙商证券   | -              | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华泰证券   | -              | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 招商证券   | -              | -            | 2,776,000,000.00 | 9.34%          | -    | -            | -    | -            |
| 东方证券   | -              | -            | 1,480,000,000.00 | 4.98%          | -    | -            | -    | -            |
| 国信证券   | -              | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 国泰君安   | -              | -            | 1,873,000,000.00 | 6.30%          | -    | -            | -    | -            |
| 天风证券   | -              | -            | 5,751,500,000.00 | 19.36%         | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券   | -              | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中金公司   | -              | -            | 668,000,000.00   | 2.25%          | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券   | -              | -            | 1,173,000,000.00 | 3.95%          | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投   | -              | -            | 320,000,000.00   | 1.08%          | -    | -            | -    | -            |
| 东吴证券   | -              | -            | 1,094,000,000.00 | 3.68%          | -    | -            | -    | -            |
| 兴业证券   | 100,447,504.80 | 99.21%       | 2,500,000,000.00 | 8.41%          | -    | -            | -    | -            |
| 申万宏源证券 | -              | -            | 505,000,000.00   | 1.70%          | -    | -            | -    | -            |
| 海通证券   | -              | -            | 4,160,000,000.00 | 14.00%         | -    | -            | -    | -            |
| 华福证券   | -              | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 安信证券   | -              | -            | 3,310,000,000.00 | 11.14%         | -    | -            | -    | -            |
| 平安证券   | -              | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |

|      |            |       |                  |        |   |   |   |   |
|------|------------|-------|------------------|--------|---|---|---|---|
| 东兴证券 | -          | -     | -                | -      | - | - | - | - |
| 西部证券 | -          | -     | -                | -      | - | - | - | - |
| 国金证券 | 795,159.00 | 0.79% | 4,101,000,000.00 | 13.80% | - | - | - | - |

注1：本报告期内基金新增23个证券公司交易单元，分别为兴业证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，国信证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，华福证券有限责任公司上交所及深交所交易单元，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，中信证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，西部证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，中泰证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，长江证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，广发证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，方正证券股份有限公司上交所及深交所交易单元，天风证券股份有限公司上交所交易单元。

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

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

注3：基金选择证券公司交易单元的选择程序如下：

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

## 10.8 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  | 圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金合同生效公告 | 上证报    | 2018-01-30 |
| 2  | 圆信永丰优悦生活混合型证              | 上证报    | 2018-03-30 |

|   |  |      |            |
|---|--|------|------------|
|   | 券投资基金开放日常申购、赎回业务公告   |      |            |
| 3 | 圆信永丰基金管理有限公司关于新增上海凯石财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开放定投、转换及参加其申购、定投业务费率优惠活动的公告      | 上证报  | 2018-03-30 |
| 4 | 圆信永丰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告                      | 上证报  | 2018-03-30 |
| 5 | 圆信永丰基金管理有限公司关于新增德邦证券股份有限公司为旗下部分基金的销售机构并开放申购、赎回、定投、转换及参加其申购、定投业务费率优惠活动的公告   | 证券时报 | 2018-04-09 |
| 6 | 圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金2018年第1季度报告   | 上证报  | 2018-04-23 |
| 7 | 圆信永丰基金管理有限公司关于新增上海有鱼基金销售有限公司为旗下部分基金的销售机构并开放申购、赎回、定投、转换及参加其申购、定投业务费率优惠活动的公告 | 证券时报 | 2018-05-02 |
| 8 | 圆信永丰基金管理有限公司关于对通过直销中心柜台申购旗下部分证券投资基金实施申购费率优惠的公告                             | 证券时报 | 2018-06-06 |
| 9 | 圆信永丰基金管理有限公司   | 证券日报 | 2018-06-29 |

|  |  |  |  |
|--|--|--|--|
|  | 关于新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金的销售机构并开放申购、赎回、定投、转换及参加其申购、定投业务费率优惠活动的公告 |  |  |
|--|--|--|--|

## § 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

报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《圆信永丰优悦生活混合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。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人圆信永丰基金管理有限公司。

咨询电话：4006070088

公司网址：<http://www.gtsfund.com.cn>

圆信永丰基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日