圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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：2019年03月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	圆信永丰优享生活
基金主代码	004958
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年08月30日
基金管理人	圆信永丰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	533,261,658.91份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注中国健康生活产品发展过程中带来的投资机会，综合运用多种投资策略，精选健康生活产业及相关产业中的优质企业进行投资，在充分控制风险的前提下，灵活配置股票、债券等大类资产，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上，自上而下调整基金大类资产配置和股票行业配置策略，确定债券组合久期和债券类别配置；在严谨深入的股票和债券研究分析基础上，自下而上精选个券。其中，本基金股票投资重点关注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。
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
信息披露负责人	姓名	吕富强	郭明
	联系电话	021-60366000	010-66105799
	电子邮箱	service@gtsfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006070088	95588
传真		021-60366006	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	圆信永丰基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦19楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年8月30日（基金合同生效日）-2017年12月31日
本期已实现收益	-5,080,267.85	29,142,112.12
本期利润	-105,914,254.01	47,791,266.78
本期基金份额净值增长率	-20.55%	3.73%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末
期末基金资产净值	439,440,657.43	1,057,899,419.73
期末基金份额净值	0.8241	1.0373

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：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

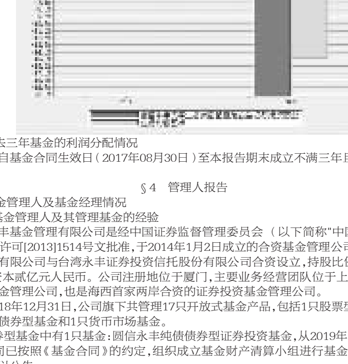
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-11.05%	1.52%	-7.54%	1.06%	-3.51%	0.46%
过去六个月	-14.68%	1.43%	-8.37%	0.97%	-6.31%	0.46%
过去一年	-20.55%	1.29%	-15.25%	0.87%	-5.30%	0.42%
自基金合同生效起至今	-17.59%	1.16%	-12.36%	0.78%	-5.23%	0.38%

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

注：自基金合同生效日起，截止报告期末，本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2017年08月30日）至本报告期末成立不满三年且未发生利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

圆信永丰基金管理有限公司是经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"或"证监会"）证监许可[2013]1514号文批准，于2014年1月2日成立的合资基金管理公司。本公司由厦门国际信托有限公司与台湾永丰证券投资信托股份有限公司合资设立，持股比例分别为51%和49%，注册资本贰亿元人民币。公司注册地位于厦门，主要业务经营团队位于上海，是厦门首家证券投资基金管理公司，也是海西首家两岸合资的证券投资基金管理公司。

截止2018年12月31日，公司旗下共管理17只开放式基金产品，包括1只股票型基金、9只混合型基金、6只债券型基金和1只货币市场基金。

6只债券型基金中有1只基金：圆信永丰纯债债券型证券投资基金，从2019年1月25日起进入清算期，公司已按照《基金合同》的约定，组织成立基金财产清算小组进行基金财产清算程序，并将及时予以公告。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
范妍	本基金基金经理	2017-08-30	–	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	2017-09-14	–	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：范妍的"任职日期"为基金合同生效之日，肖世源的"任职日期"为公告确定的聘任日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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和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 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行上述公平交易制度和控制方法，开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的整体收益率差异，以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析，对以公司名义进行的一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控等，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中，在同向交易的监控和分析方面，根据法规要求，公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控，通过定期抽查前述的同向交易行为，定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势，重点关注任何可能导致不公平交易的情形。对于识别的异常情况，由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时，公司根据法规的要求，通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗下（T=1日、T=3日、T=5日）的同向交易价差进行分析，采用概率统计方法，重点关注不同投资组合之间同向交易溢价率均值是否为零的t检验，以及同向交易价格占优的交易次数比占比等。在一级市场申购和分配方面，事前对申购指令单进行审核监控，事后对以公司名义进行的申购指令单进行核查，确保分配结果符合公平交易的原则。

报告期内，通过前述分析方法，未发现公司旗下不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，基金管理人未发现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

虽然在2017年末，我们预期2018年经济会出现一定程度的调整，流动性同时收紧。但实际过程中，我们观察到流动性与企业盈利自二、三季度开始，下滑速度还是很快的。

全年大部分时间，我们保持了较低的基金仓位，上半年在部分行业估值上行时做了一定的止盈动作和行业切换，如医药和银行。但是下半年市场单边下跌中，风电、医药、LED、白酒、房地产后周期等板块轮番下跌，防御性板块也并不防御。年末，我们的配置转向必需消费品和受益于成本下降产品盈利相对稳定的板块。

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享生活基金份额净值为0.8241元，本报告期内，基金份额净值增长率为-20.55%，同期业绩比较基准收益率为-15.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年的波动目前来看远远高于2018年，主要的冲击来自于资金面。1月份开始，北上资金大幅流入，连续两个月流入资金量超过了600亿元。北上资金是外资流入的主要资金来源，根据我们的统计，北上资金的配置非常集中，约40%的北上资金配置集中于10个股票，80%的北上资金配置集中在100个股票。食品饮料、家电、金融等行业龙头出现估值的上行。2月份开始，我们看到个人投资者开始活跃，以融资融券为例，春节以来，融资金额日均增长超过70亿元。两者相加，资金量接近2014年11月份的水平。个人投资者的投资偏向容易识别的主题，例如科创板、5G等等。

我们预期，外资的配置主要是基于国别的配置增加，和国内基本面的关系相关度不高，这从2018年的海外资金流入模式可以看出，全年增量资金的规模可能达到万亿，外资的战略配置将持续影响市场。融资融券或者个人投资者入市资金规模则难以判断其持续性和规模，但在资金的影响下，市场的波动会非常大。

相应的，我们对于投资策略相应的改为哑铃型组合，配置偏向两头：一类是海外资金配置偏向的蓝筹股（银行、地产除外），一类是未来具有成长性，容易被个人投资者识别的行业和主题。

对于宏观经济，我们认为今年大概率仍然处于下行的周期，乘用车、一线房地产市场出现了稍微的需求改善，基建温和回暖，民企融资和地产融资也有改善，但目前的改善程度远远不能改变我们对于盈利下行周期的判断。此外，还需要观察流动性陷阱是否会出现，如果资金面的情况逆转，我们将相应调整仓位，应对潜在风险。

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年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第20850号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金（以下简称"圆信永丰优享生活基金"）的财务报表，包括2018年12月31日的资产负债表，2018年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二) 我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了圆信永丰优享生活基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。	
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于圆信永丰优享生活基金，并履行了职业道德方面的其他责任。	
强调事项	–	
其他事项	–	
其他信息	–	
管理层和治理层对财务报表的责任	圆信永丰优享生活基金的基金管理人圆信永丰基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估圆信永丰优享生活基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算圆信永丰优享生活基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督圆信永丰优享生活基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对圆信永丰优享生活基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致圆信永丰优享生活基金不能持续经营。(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	单峰	张晓阳
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼	
审计报告日期	2019-03-26	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	16,359,590.69	6,697,949.19
结算备付金	3,938,089.40	32,710,048.59
存出保证金	160,589.24	283,249.57
交易性金融资产	362,106,797.51	921,442,858.42
其中：股票投资	342,765,280.09	866,221,714.22
基金投资	–	–
债券投资	19,341,517.42	55,221,144.20
资产支持证券投资	–	–
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	47,000,000.00	80,060,210.09
应收证券清算款	10,808,469.67	28,114,328.24
应收利息	370,342.74	1,098,594.84
应收股利	–	–
应收申购款	21,095.69	369,108.23
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	440,764,974.94	1,070,776,347.17
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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	–	5,931,680.17
应付赎回款	157,008.13	3,959,996.59
应付管理人报酬	580,955.28	1,396,250.19
应付托管费	77,460.71	186,166.66
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	448,863.36	1,293,081.68
应交税费	30.03	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	60,000.00	109,752.15
负债合计	1,324,317.51	12,876,927.44
所有者权益：		
实收基金	533,261,658.91	1,019,884,870.55
未分配利润	-93,821,001.48	38,014,549.18
所有者权益合计	439,440,657.43	1,057,899,419.73
负债和所有者权益总计	440,764,974.94	1,070,776,347.17

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值0.8241元，基金份额总额533,261,658.91份。

7.2 利润表

会计主体：圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年08月30日（基金合同生效日）至2017年12月31日
一、收入	-91,670,769.19	57,186,921.21
1.利息收入	2,921,056.72	9,206,606.18
其中：存款利息收入	272,418.26	4,770,499.84
债券利息收入	1,427,258.31	626,032.61
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	1,221,380.15	3,810,073.73
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以"-"填列）	5,410,363.64	28,257,715.68
其中：股票投资收益	-1,329,687.53	28,082,658.60
基金投资收益	–	–
债券投资收益	-81,735.27	47,064.96
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	6,821,786.44	127,992.12
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-100,833,986.16	18,649,154.66
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	–	–
5.其他收入（损失以"-"号填列）	831,796.61	1,073,444.69
减：二、费用	14,243,484.82	9,395,654.43
1. 管理人报酬	9,010,613.11	6,174,722.14
2. 托管费	1,201,415.05	823,296.26
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	3,862,291.42	2,295,999.43
5. 利息支出	–	–
其中：卖出回购金融资产支出	–	–
6. 税金及附加	4.58	–
7. 其他费用	169,160.66	101,636.60
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-105,914,254.01	47,791,266.78
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-105,914,254.01	47,791,266.78

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,019,884,870.55	38,014,549.18	1,057,899,419.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-105,914,254.01	-105,914,254.01
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）	-486,623,211.64	-25,921,296.65	-512,544,508.29
其中：1.基金申购款	37,953,052.74	1,014,903.90	38,967,956.64
2.基金赎回款	-524,576,264.38	-26,936,200.55	-551,512,464.93
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）	533,261,658.91	-93,821,001.48	439,440,657.43
项目	上年度可比期间 2017年08月30日（基金合同生效日）至2017年12月31日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,276,188,248.02	–	1,276,188,248.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	47,791,266.78	47,791,266.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-256,303,377.47	-9,776,717.60	-266,080,095.07
其中：1.基金申购款	50,951,568.88	1,838,759.18	52,790,328.06
2.基金赎回款	-307,254,946.35	-11,615,476.78	-318,870,423.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	1,019,884,870.55	38,014,549.18	1,057,899,419.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围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、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、中小企业私募债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的0%-95%。投资于优享生活主题相关的证券比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，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%。

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2019年3月26日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2017年8月30日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 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、债券投资和资产支持证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债金融估值中心有限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债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。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。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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
圆信永丰基金管理有限公司（“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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

无。

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 债券交易

无。

7.4.8.1.4 债券回购交易

无。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年08月30日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,010,613.11	6,174,722.14
其中：支付销售机构的客户维护费	4,334,738.57	3,323,682.62

注：支付基金管理人圆信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年08月30日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,201,415.05	823,296.26

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

日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年08月30日（基金合同生效日）至2017年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国工商银行	16,359,590.69	192,952.24	6,697,949.19	255,423.42

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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
7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	新股未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	–
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
110049	海尔转债	2018-12-19	2019-01-18	新债未上市	100.00	100.00	2,470	247,000.00	247,000.00	–

注1：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

注2：基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018-12-25	重大事项	16.01	2019-01-10	17.15	910,000	15,619,268.00	14,569,100.00	–

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为331,673,901.71元，属于第二层次的余额为30,432,895.80元，无属于第三层次的余额。(2017年12月31日：属于第一层次的余额为866,073,206.02元，属于第二层次的余额为55,369,652.40元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。(2017年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	342,765,280.09	77.77
	其中：股票	342,765,280.09	77.77
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	19,341,517.42	4.39
	其中：债券	19,341,517.42	4.39
	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	47,000,000.00	10.66
	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	20,297,680.09	4.61
8	其他各项资产	11,360,497.34	2.58
9	合计	440,764,974.94	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	22,026,215.20	5.01
B	采矿业	13,475,004.90	3.07
C	制造业	237,167,612.66	53.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,392,727.53	5.10
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	8,568,060.00	1.95
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,853,000.00	0.42
J	金融业	27,618,249.80	6.28
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	1,719,410.00	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	56,600.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	7,888,400.00	1.80
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	342,765,280.09	78.00

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002179	中航光电	656,422	22,108,292.96	5.03
2	600887	伊利股份	850,000	19,448,000.00	4.43
3	600011	华能国际	2,406,181	17,757,615.78	4.04
4	600566	济川药业	500,000	16,765,000.00	3.82
5	002572	索菲亚	946,800	15,858,900.00	3.61
6	600030	中信证券	910,000	14,569,100.00	3.32
7	000651	格力电器	400,000	14,276,000.00	3.25
8	600703	三安光电	1,249,919	14,136,583.89	3.22
9	600583	海油工程	2,750,001	13,475,004.90	3.07
10	002415	海康威视	500,000	12,880,000.00	2.93

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002299	圣农发展	35,495,118.42	3.36
2	600011	华能国际	32,969,308.20	3.12
3	002511	中顺洁柔	32,249,550.46	3.05
4	002583	海能达	30,242,994.98	2.86
5	600703	三安光电	29,969,338.85	2.83
6	002415	海康威视	26,500,742.97	2.51
7	600887	伊利股份	24,548,867.00	2.32
8	600048	保利地产	24,093,495.00	2.28
9	002456	欧菲科技	23,400,886.04	2.21
10	000002	万科A	23,107,343.17	2.18
11	600566	济川药业	23,054,185.00	2.18
12	600029	南方航空	22,110,092.40	2.09
13	600038	中直股份	21,894,499.14	2.07
14	002202	金风科技	21,758,201.60	2.06
15	600521	华海药业	21,151,300.80	2.00
16	002572	索菲亚	21,141,284.77	2.00
17	000513	丽珠集团	20,469,900.28	1.93
18	600583	海油工程	20,454,313.67	1.93
19	002179	中航光电	19,961,852.57	1.89
20	601939	建设银行	19,485,921.16	1.84

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	59,596,110.10	5.63
2	000513	丽珠集团	56,768,325.94	5.37
3	600406	国电南瑞	52,665,098.43	4.98
4	000651	格力电器	48,356,444.27	4.57
5	600029	南方航空	46,249,808.17	4.37
6	601601	中国太保	45,133,346.29	4.27
7	600887	伊利股份	43,732,441.37	4.13
8	002236	大华股份	43,366,005.97	4.10
9	000858	五粮液	40,534,135.04	3.83
10	002299	圣农发展	38,847,825.79	3.67
11	603899	晨光文具	37,727,601.81	3.57
12	600038	中直股份	36,010,925.46	3.40
13	002343	慈文传媒	30,857,802.60	2.92
14	002831	裕同科技	29,519,343.19	2.79
15	601688	华泰证券	29,396,009.47	2.78
16	000001	平安银行	27,740,813.98	2.62
17	300365	恒华科技	27,397,733.48	2.59
18	300232	洲明科技	27,172,972.99	2.57
19	600028	中国石化	24,574,260.10	2.32
20	603589	口子窖	24,494,526.09	2.32
21	002179	中航光电	24,172,303.30	2.28
22	000703	恒逸石化	23,998,491.77	2.27
23	002511	中顺洁柔	23,250,860.61	2.20
24	002624	完美世界	22,239,101.69	2.10
25	002456	欧菲科技	21,582,267.67	2.04

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,063,119,454.26
卖出股票收入（成交）总额	1,484,196,583.98

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	15,566,650.00	3.54
	其中：政策性金融债	15,566,650.00	3.54
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）	3,774,867.42	0.86
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	19,341,517.42	4.40

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	180407	18农发07	155,000	15,566,650.00	3.54
2	123016	洲明转债	25,184	2,567,256.96	0.58
3	128047	光电转债	9,047	960,610.46	0.22
4	110049	海尔转债	2,470	247,000.00	0.06

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同约定，本基金不参与国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 通过查阅中国证监会网站公开目录"行政处罚决定"及查阅相关发行主体的公司公告，在基金管理人知悉的范围内，报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超过基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	160,589.24
2	应收证券清算款	10,808,469.67
3	应收股利	–
4	应收利息	370,342.74
5	应收申购款	21,095.69
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	11,360,497.34

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	14,569,100.00	3.32	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
7,008	76,093.27	9,999,200.00	1.88%	523,262,458.91	98.12%

9.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,736,390.06	0.33%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年08月30日)基金份额总额	1,276,188,248.02
本报告期期初基金份额总额	1,019,884,870.55
本报告期基金总申购份额	37,953,052.74
减：本报告期基金总赎回份额	524,576,264.38
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	533,261,658.91

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期内应支付审计费用6万元。该审计机构已提供审计服务的持续年限为2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人和托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
华泰证券	1	82,610,189.85	3.25%	60,413.02	2.81%	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	2	–	–	–	–	–
光大证券	2	61,792,085.57	2.43%	39,009.24	1.81%	–
海通证券	2	337,994,544.64	13.29%	314,774.01	14.63%	–
中信建投	2	101,620,448.87	4.00%	94,640.88	4.40%	–
中信证券	2	100,594,782.50	3.96%	93,684.20	4.35%	–
天风证券	2	196,283,720.05	7.72%	143,542.84	6.67%	–
国泰君安	2	196,811,951.08	7.74%	183,291.07	8.52%	–
东吴证券	2	137,065,769.60	5.39%	100,235.80	4.66%	–
中泰证券	2	–	–	–	–	–
中金公司	2	113,162,534.26	4.45%	105,387.15	4.90%	–
国信证券	2	–	–	–	–	–
平安证券	2	–	–	–	–	–
华福证券	2	–	–	–	–	–
西部证券	2	–	–	–	–	–
招商证券	2	231,944,434.90	9.12%	216,009.64	10.04%	–
安信证券	2	191,686,738.17	7.54%	178,518.11	8.29%	–
东方证券	2	341,237,559.81	13.42%	249,544.77	11.60%	–
申万宏源证券	2	220,024,433.75	8.65%	204,909.55	9.52%	–
国金证券	2	229,990,301.43	9.04%	168,191.36	7.82%	–
东兴证券	2	–	–	–	–	–

注1：本报告期内基金新增2个证券公司交易单元，分别为光大证券股份有限公司上交所及深交所交易单元。

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

（1）资金实力雄厚，财务状况良好；

（2）经营行为稳健文件规范，在业内有良好的声誉；

（3）内控制度健全，内部管理严格；并能满足基金运作高度保密的要求；

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

（5）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员；

（6）具备较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较强的研究综合实力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、策略、行业、个股分析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要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他业务的开展提供良好的服务和支持。

注3：基金选择证券公司交易单元的选择程序如下：

（1）本基金管理人根据上述选择标准对证券公司进行考察后，确定拟选用交易单元的证券经营机构；

（2）本基金管理人与和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例	基金交易 成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	–	–	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–	–	–
光大证券	2,116,880.09	3.28%	347,000,000.00	4.77%	–	–	–	–
海通证券	–	–	880,000,000.00	12.11%	–	–	–	–
中信建投	–	–	354,000,000.00	4.87%	–	–	–	–
中信证券	–	–	617,000,000.00	8.49%	–	–	–	–
天风证券	10,771,830.62	16.67%	551,500,000.00	7.59%	–	–	–	–
国泰君安	–	–	678,000,000.00	9.33%	–	–	–	–
东吴证券	40,015,084.00	61.93%	450,000,000.00	6.19%	–	–	–	–
中泰证券	–	–	–	–	–	–	–	–
中金公司	671,072.00	1.04%	482,000,000.00	6.63%	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–	–	–
华福证券	–	–	–	–	–	–	–	–
西部证券	–	–	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	570,800,000.00	7.85%	–	–	–	–
安信证券	–	–	442,400,000.00	6.09%	–	–	–	–
东方证券	–	–	974,400,000.00	13.41%	–	–	–	–
申万宏源证券	–	–	461,000,000.00	6.34%	–	–	–	–
国金证券	11,042,208.00	17.09%	460,500,000.00	6.34%	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

圆信永丰基金管理有限公司
二〇一九年三月二十八日