

圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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:2024 年 08 月 30 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的法律责任。本中期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2024年8月29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2024年1月1日起至2024年6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	6
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	7
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	49
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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§9 开放式基金份额变动	52
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§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	189,904,149.63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。本基金定义的优悦生活主题，重点关注能够为居民生活消费提供优质的服务，能够使居民在生活健康以及物质精神生活质量等方面感受到愉悦和满足等等。本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略。
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	兰文伟	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		021-60366001	010-66105798
注册地址		中国（福建）自由贸易试验区厦门片区（保税港区）海景南二路45号4楼402单元之175	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1528号陆家嘴基金大厦19楼	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		胡荣炜	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtsfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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 (2024年01月01日 - 2024年06月30日)
本期已实现收益	-121,985,663.56
本期利润	-35,324,436.84
加权平均基金份额本期利润	-0.1167
本期加权平均净值利润率	-6.81%
本期基金份额净值增长率	-6.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末可供分配利润	129,608,480.63
期末可供分配基金份额利润	0.6825
期末基金资产净值	319,512,630.26
期末基金份额净值	1.6825
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	84.45%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

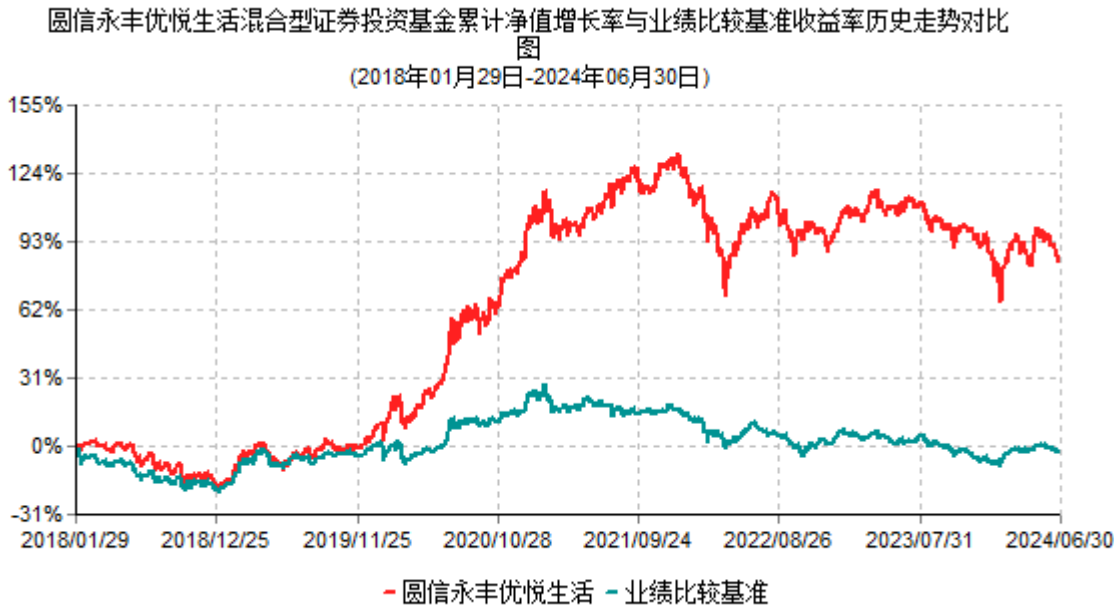
3.2 基金净值表现

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
----	--------------	---------------------	--------------------	---------------------------	-----	-----

过去一个月	-4.84%	0.65%	-1.92%	0.31%	-2.92%	0.34%
过去三个月	-3.22%	1.02%	-0.70%	0.49%	-2.52%	0.53%
过去六个月	-6.09%	1.20%	2.06%	0.58%	-8.15%	0.62%
过去一年	-12.90%	0.96%	-4.55%	0.57%	-8.35%	0.39%
过去三年	-12.12%	1.00%	-18.99%	0.68%	6.87%	0.32%
自基金合同生效起至今	84.45%	1.13%	-2.67%	0.79%	87.12%	0.34%

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



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

圆信永丰基金管理有限公司是经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”或“证监会”）证监许可[2013]1514号文批准，于2014年1月2日成立的合资基金管理公司。本公司由厦门国际信托有限公司与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2024年6月30日，公司旗下共管理31只开放式基金产品，包括4只股票型基金、17只混合型基金、9只债券型基金和1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		
党伟	本基金基金经理	2024-04-03	-	8年	上海复旦大学金融专业硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司权益投资部基金经理。历任圆信永丰基金管理有限公司研究部助理研究员、研究员。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格证。
范妍	本基金基金经理	2018-01-29	2024-04-03	16年	复旦大学管理学硕士，历任兴业证券股份有限公司研究部策略研究助理，安信证券股份有限公司研究部策略分析师，工银瑞信基金管理有限公司专户部高级策略分析师，圆信永丰基金管理有限公司权益投资部基金经理助理、副总监、总监、圆信永丰基金管理有限公司副总经理兼首席投资官。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相关规定。
注2：党伟的"任职日期"为公告确定的任职日期。
注3：范妍的“离任日期”为公告确定的离任日期。

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，基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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、私募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

本基金上半年基金经理有所变动。2季度以来本基金由新任基金经理管理，配置思路有所改变，主要为高仓位背景下精选个股。综合考虑时代发展特征、行业发展趋势、产业周期以及公司综合竞争能力，结合估值水平和期望收益率挑选个股构建投资组合。

组合分散度方面，目标是尽可能集中，对于能力圈范围内的高确定性标的需要配置足够的仓位。

2024年2季度以来本基金主要配置行业包括电力设备及新能源、汽车、通信、化工、农林牧渔、医药、有色等。

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1.6825元，本报告期内，基金份额净值增长率为-6.09%，同期业绩比较基准收益率为2.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面，上半年国内经济运行基本平稳，海外北美大国在高利率背景下经济韧性较强，新兴市场国家增长强劲。全球整体平稳。

证券市场方面，国内权益市场上半年波动比较大。开年受流动性等因素影响中小市值股票经历了较大幅度回撤，春节后整体市场有所回暖，上半年最后一个月整体市场再次回调。从数据上看，截止2024年上半年末，深证成指经历了连续5个季度下跌。估值角度，深成指PB倍数6月30日为1.96倍，接近上一轮2018年调整期的最低点，为2014年以来4.85%的历史分位数。估值上，我们的权益市场处在历史底部，基本面上，当前整体上市公司的ROE水平仍然处在下行通道，预计2024年ROE出现新低（根据深成指数据预估），在ROE没有见底，同时没有大的政策以及经济预期改变之前，市场难言有较大的上行机会，整体估值水平可能还会面临压力。

行业方面，在整体上市公司ROE走弱，估值水平持续承压的背景下。以公用事业为代表的高盈利确定性高分红行业表现持续超越整体市场。代表性龙头公司的股息率甚至接近10年期国债收益率，侧面反映出权益市场的艰难，市场参与者很难寻找到高成长确定性的行业，纷纷采取保守投资策略，以前市场弃之如敝履的个位数增长个位数估值的稳定行业纷纷跑出靓丽的超额收益。然而我们仍然相信水满则溢月盈则亏的朴素自然规律，任何行业都需要遵循周期规律。我们仍然对于我们的组合充满信心。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并设立估值委员会具体负责监督执行。估值委员会的成员由首席投资官或其授权代表、清算登记部分管领导、研

究部负责人、监察稽核部总监、风险管理部总监、清算登记部总监和经办基金会计组成。估值委员会负责组织制定、评估和适时修订基金估值政策和程序，并指导和监督整个估值流程。估值委员会成员包括基金核算、行业研究等方面的业务骨干，均具有基金从业资格、专业胜任能力和丰富的工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期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2024年中期报告中财务指标、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：2024年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	250,733.22	2,753,291.30
结算备付金		748,668.82	5,681,668.54
存出保证金		128,184.13	62,653.38
交易性金融资产	6.4.7.2	288,424,523.59	701,344,933.71
其中：股票投资		229,204,259.30	607,013,288.19
基金投资		-	-
债券投资		59,220,264.29	94,331,645.52
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	31,150,000.00	50,994,506.84
应收清算款		2,609,944.27	1,512,941.63
应收股利		-	-
应收申购款		22,201.49	1,200,577.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		323,334,255.52	763,550,572.41
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
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		-	-
应付清算款		1,561,280.59	224,127.88
应付赎回款		1,120,587.20	572,432.72
应付管理人报酬		330,132.79	769,916.63
应付托管费		55,022.12	128,319.40
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		629.35	123.51
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	753,973.21	467,295.89
负债合计		3,821,625.26	2,162,216.03
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	189,904,149.63	424,980,215.66
未分配利润	6.4.7.8	129,608,480.63	336,408,140.72
净资产合计		319,512,630.26	761,388,356.38
负债和净资产总计		323,334,255.52	763,550,572.41

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额净值1.6825元，基金份额总额189,904,149.63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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-31,554,914.31	69,797,853.34
1.利息收入		571,222.96	726,289.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	64,922.58	59,789.77

债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		506,300.38	666,499.36
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-118,983,111.76	22,731,031.83
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-121,510,901.91	17,845,207.94
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	483,774.07	1,255,718.57
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,044,016.08	3,630,105.32
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	86,661,226.72	46,216,571.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	195,747.77	123,960.39
减：二、营业总支出		3,769,522.53	6,129,895.82
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,115,554.84	5,293,468.43
2.托管费	6.4.10.2.2	519,259.19	705,795.76
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		239.63	36.95
8.其他费用	6.4.7.20	134,468.87	130,594.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-35,324,436.84	63,667,957.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-35,324,436.84	63,667,957.52
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-35,324,436.84	63,667,957.52

6.3 净资产变动表

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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	424,980,215.66	336,408,140.72	761,388,356.38
二、本期期初净资产	424,980,215.66	336,408,140.72	761,388,356.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-235,076,066.03	-206,799,660.09	-441,875,726.12
（一）、综合收益总额	-	-35,324,436.84	-35,324,436.84
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填	-235,076,066.03	-171,475,223.25	-406,551,289.28

列)			
其中：1.基金申购款	26,534,052.40	18,445,077.10	44,979,129.50
2.基金赎回款	-261,610,118.43	-189,920,300.35	-451,530,418.78
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	189,904,149.63	129,608,480.63	319,512,630.26
项 目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	384,475,624.24	291,804,647.70	676,280,271.94
二、本期期初净资产	384,475,624.24	291,804,647.70	676,280,271.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	17,232,967.57	82,427,215.34	99,660,182.91
(一)、综合收益总额	-	63,667,957.52	63,667,957.52
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	17,232,967.57	18,759,257.82	35,992,225.39
其中：1.基金申购款	96,377,512.62	87,724,266.71	184,101,779.33
2.基金赎回款	-79,144,545.05	-68,965,008.89	-148,109,553.94
(三)、本期向基金份额持有人分配	-	-	-

利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	401,708,591.81	374,231,863.04	775,940,454.85

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：

高健	姚德明	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》注册，由圆信永丰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰优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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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<年度报告和中期报告>》、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2024年中期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2024年6月30日的财务状况以及2024年中期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
----	--------------------

活期存款	250,733.22
等于：本金	249,970.13
加：应计利息	763.09
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	250,733.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		242,490,090.69	-	229,204,259.30	-13,285,831.39
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	39,006,940.94	93,922.63	38,946,894.43	-153,969.14
	银行间市场	20,125,780.00	141,369.86	20,273,369.86	6,220.00
	合计	59,132,720.94	235,292.49	59,220,264.29	-147,749.14
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	301,622,811.63	235,292.49	288,424,523.59	-13,433,580.53
----	----------------	------------	----------------	----------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	31,150,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	31,150,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	152.21
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	635,422.62
其中：交易所市场	635,057.62
银行间市场	365.00
应付利息	-

预提费用	118,398.38
合计	753,973.21

注：此处应付赎回费含应付转出费。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	424,980,215.66	424,980,215.66
本期申购	26,534,052.40	26,534,052.40
本期赎回（以“-”号填列）	-261,610,118.43	-261,610,118.43
本期末	189,904,149.63	189,904,149.63

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	467,142,760.90	-130,734,620.18	336,408,140.72
本期期初	467,142,760.90	-130,734,620.18	336,408,140.72
本期利润	-121,985,663.56	86,661,226.72	-35,324,436.84
本期基金份额交易产生的变动数	-213,375,578.79	41,900,355.54	-171,475,223.25
其中：基金申购款	26,779,411.18	-8,334,334.08	18,445,077.10
基金赎回款	-240,154,989.97	50,234,689.62	-189,920,300.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	131,781,518.55	-2,173,037.92	129,608,480.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日

活期存款利息收入	15,998.67
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	48,290.69
其他	633.22
合计	64,922.58

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	772,056,214.73
减：卖出股票成本总额	892,104,366.44
减：交易费用	1,462,750.20
买卖股票差价收入	-121,510,901.91

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	572,337.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-88,563.58
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	483,774.07

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	119,102,161.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	116,602,432.13
减：应计利息总额	2,584,525.01
减：交易费用	3,767.85
买卖债券差价收入	-88,563.58

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,044,016.08
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,044,016.08

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	86,661,226.72
——股票投资	87,199,639.11
——债券投资	-538,412.39
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	86,661,226.72

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	195,540.54
转换费收入	207.23
合计	195,747.77

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50%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50%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	6,470.49
账户维护费	18,600.00
合计	134,468.87

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

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

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,115,554.84	5,293,468.43
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,125,275.74	1,817,439.79
应支付基金管理人的净管理费	1,990,279.10	3,476,028.64

注：于2023年8月21日前，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。

根据《圆信永丰基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等事项的公告》，自2023年8月21日起，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1.20%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：
日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日

当期发生的基金应支付的托管费	519,259.19	705,795.76
----------------	------------	------------

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期	250,733.22	15,998.67	3,636,691.34	10,058.57

存款				
----	--	--	--	--

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2024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	受限期	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
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内（含）	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月以上	科创板打新限售	15.69	18.77	1,045	16,396.05	19,614.65	-
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内（含）	新股未上市	20.56	20.56	945.00	19,429.20	19,429.20	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月以上	创业板打新限售	11.88	23.32	711.00	8,446.68	16,580.52	-

301580	爱迪特	2024-06-19	6个月以上	创业板打新限售	44.95	74.00	202.00	9,079.90	14,948.00	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月以上	科创板打新限售	22.66	15.87	866.00	19,623.56	13,743.42	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月以上	创业板打新限售	55.82	91.22	107.00	5,972.74	9,760.54	-
301538	骏鼎达	2024-05-22	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	91.22	43.00	-	3,922.46	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月以上	创业板打新限售	12.20	55.87	219.00	2,671.80	12,235.53	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月以上	科创板打新限售	19.86	49.38	247.00	4,905.42	12,196.86	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	创业板打新限售	8.90	16.75	576.00	5,126.40	9,648.00	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月以上	创业板打新限售	21.73	27.10	306.00	6,649.38	8,292.60	-

301591	肯特股份	2024-02-20	6个月以上	创业板打新限售	19.43	36.92	219.00	4,255.17	8,085.48	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月以上	科创板打新限售	9.60	18.96	344.00	3,302.40	6,522.24	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月以上	科创板打新限售	22.43	31.54	186.00	4,171.98	5,866.44	-
301588	美新科技	2024-03-06	6个月以上	创业板打新限售	14.50	21.25	257.00	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月以上	创业板打新限售	28.01	37.81	138.00	3,865.38	5,217.78	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月以上	上交所打新限售	19.18	22.66	182.00	3,490.76	4,124.12	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月以上	上交所打新限售	23.35	26.59	145.00	3,385.75	3,855.55	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月以上	深交所打新限售	17.39	20.61	184.00	3,199.76	3,792.24	-
603312	西典	2024-01-0	6个月以	上交	29.02	25.34	130.00	3,772.60	3,294.20	-

	新能	4	上	所打 新限 售						
6030 82	北自 科技	2024 -01-2 3	6个月以 上	上交 所打 新限 售	21.28	29.48	107.00	2,27 6.96	3,15 4.36	-
0013 79	腾达 科技	2024 -01-1 1	6个月以 上	深交 所打 新限 售	16.98	13.48	213.00	3,61 6.74	2,87 1.24	-
6033 75	盛景 微	2024 -01-1 7	6个月以 上	上交 所打 新限 售	38.18	38.88	72.00	2,74 8.96	2,79 9.36	-
0013 87	雪祺 电气	2024 -01-0 4	6个月以 上	深交 所打 新限 售	15.38	15.23	133.00	2,04 5.54	2,02 5.59	-
0013 87	雪祺 电气	2024 -06-0 3	1-6个月 (含)	深交 所打 新限 售送 股	-	15.23	40.00	-	609.2 0	-
6032 85	键邦 股份	2024 -06-2 8	6个月以 上	上交 所打 新限 售	18.65	18.65	129.00	2,40 5.85	2,40 5.85	-
6033 50	安乃 达	2024 -06-2 6	6个月以 上	上交 所打 新限 售	20.56	20.56	106.00	2,17 9.36	2,17 9.36	-

注1：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获

得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

注2：基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

注3：基金作为特定投资者，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。

注4：基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金为混合型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(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)。

本基金的基金管理人实行全面风险管理与全员风险管理。基金管理人以各岗位目标责任制为基础的第一道内控防线，员工在自律的前提下，相互监督制衡。各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在授权范围内承担责任；以相关部门、

相关岗位之间相互监督制衡的第二道内控防线，公司在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督责任；以公司督察长、监察稽核部门对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道防线，督察长、监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈；以董事会下属风险与合规管理委员会对公司经营管理和基金运作中的合法合规性实行全面监督的第四道防线。风险与合规管理委员会对公司经营和基金运作中的风险进行严格的合规检查和风险控制评估并审议公司风险管理工作报告。董事会对基金管理人的风险管理负有最终责任。

本基金的基金管理人建立科学严密的风险评估体系，对内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险；建立完整的风险控制程序，包括风险识别、风险评估、风险控制和风险监督；对各部门和各业务循环存在的风险点进行识别评估，并建立相应的控制措施；使用科学的风险量化技术和严格的风险限额控制对投资风险实行定量分析和管理。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

无。

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	11,485,080.83	-
AAA以下	27,461,813.60	17,118,402.36
未评级	20,273,369.86	77,213,243.16
合计	59,220,264.29	94,331,645.52

注：未评级债券为政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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。

于2024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(净资产)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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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》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时间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公司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%，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%(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上述比例限制)。

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%。于2024年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.07%。

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。于2024年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为320,671,126.15元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中

浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资和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 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	250,733.22	-	-	-	250,733.22
结算备付金	748,668.82	-	-	-	748,668.82
存出保证金	128,184.13	-	-	-	128,184.13
交易性金融资产	20,273,369.86	34,081,767.03	4,865,127.40	229,204,259.30	288,424,523.59
买入返售金融资产	31,150,000.00	-	-	-	31,150,000.00
应收清算款	-	-	-	2,609,944.27	2,609,944.27
应收申购款	-	-	-	22,201.49	22,201.49
资产总计	52,550,956.03	34,081,767.03	4,865,127.40	231,836,405.06	323,334,255.52
负债					
应付清算款	-	-	-	1,561,280.59	1,561,280.59

应付赎回款	-	-	-	1,120,587.20	1,120,587.20
应付管理人报酬	-	-	-	330,132.79	330,132.79
应付托管费	-	-	-	55,022.12	55,022.12
应交税费	-	-	-	629.35	629.35
其他负债	-	-	-	753,973.21	753,973.21
负债总计	-	-	-	3,821,625.26	3,821,625.26
利率敏感度缺口	52,550,956.03	34,081,767.03	4,865,127.40	228,014,779.80	319,512,630.26
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,753,291.30	-	-	-	2,753,291.30
结算备付金	5,681,668.54	-	-	-	5,681,668.54
存出保证金	62,653.38	-	-	-	62,653.38
交易性金融资产	77,213,243.16	17,118,402.36	-	607,013,288.19	701,344,933.71
买入返售金融资产	50,994,506.84	-	-	-	50,994,506.84
应收清算款	-	-	-	1,512,941.63	1,512,941.63
应收申	-	-	-	1,200,577.01	1,200,577.01

购款					
资产总计	136,705,363.22	17,118,402.36	-	609,726,806.83	763,550,572.41
负债					
应付清算款	-	-	-	224,127.88	224,127.88
应付赎回款	-	-	-	572,432.72	572,432.72
应付管理人报酬	-	-	-	769,916.63	769,916.63
应付托管费	-	-	-	128,319.40	128,319.40
应交税费	-	-	-	123.51	123.51
其他负债	-	-	-	467,295.89	467,295.89
负债总计	-	-	-	2,162,216.03	2,162,216.03
利率敏感度缺口	136,705,363.22	17,118,402.36	-	607,564,590.80	761,388,356.38

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2024年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为18.53%(2023年12月31日：12.39%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023年12月31日：同)。

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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资比例为基金资产的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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，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。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 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	229,204,259.30	71.74	607,013,288.19	79.72
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	229,204,259.30	71.74	607,013,288.19	79.72

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.沪深300指数上升5%	15,936,352.37	23,050,643.32
	2.沪深300指数下降5%	-15,936,352.37	-23,050,643.32

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	267,926,920.99	623,434,519.14
第二层次	20,318,980.97	77,213,243.16
第三层次	178,621.63	697,171.41
合计	288,424,523.59	701,344,933.71

6.4.14.2.2 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、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年6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(2023年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	229,204,259.30	70.89
	其中：股票	229,204,259.30	70.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	59,220,264.29	18.32
	其中：债券	59,220,264.29	18.32
	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	31,150,000.00	9.63

	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	999,402.04	0.31
8	其他各项资产	2,760,329.89	0.85
9	合计	323,334,255.52	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	21,594,800.00	6.76
B	采矿业	12,241,000.00	3.83
C	制造业	195,229,527.88	61.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	136,512.30	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,419.12	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	229,204,259.30	71.74

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	300750	宁德时代	150,040	27,011,701.20	8.45
2	688408	中信博	167,769	15,448,169.52	4.83
3	605222	起帆电缆	1,000,100	15,341,534.00	4.80
4	601689	DR拓普集	227,000	12,169,470.00	3.81
5	002714	牧原股份	268,000	11,684,800.00	3.66
6	300627	华测导航	360,000	10,746,000.00	3.36
7	002487	大金重工	458,500	10,490,480.00	3.28
8	300498	温氏股份	500,000	9,910,000.00	3.10
9	002311	海大集团	210,000	9,880,500.00	3.09
10	603997	继峰股份	960,600	9,826,938.00	3.08
11	688212	澳华内镜	240,007	9,602,680.07	3.01
12	601677	明泰铝业	800,000	9,248,000.00	2.89
13	002028	思源电气	133,000	8,897,700.00	2.78
14	300207	欣旺达	500,000	7,585,000.00	2.37
15	603993	洛阳钼业	820,000	6,970,000.00	2.18
16	688235	百济神州	60,000	6,950,400.00	2.18
17	688301	奕瑞科技	56,752	6,539,532.96	2.05
18	605589	圣泉集团	315,300	6,397,437.00	2.00
19	000807	云铝股份	410,000	5,539,100.00	1.73
20	601899	紫金矿业	300,000	5,271,000.00	1.65
21	601799	星宇股份	43,000	4,817,720.00	1.51
22	300693	盛弘股份	230,000	4,816,200.00	1.51
23	603063	禾望电气	300,000	4,599,000.00	1.44
24	603766	隆鑫通用	658,000	4,461,240.00	1.40

25	002182	宝武镁业	359,240	4,052,227.20	1.27
26	301565	中仑新材	7,103	177,467.16	0.06
27	301580	爱迪特	2,018	155,143.20	0.05
28	301392	汇成真空	2,189	132,011.53	0.04
29	688691	灿芯股份	2,461	130,645.86	0.04
30	301587	中瑞股份	3,056	89,830.10	0.03
31	688530	欧莱新材	3,437	70,083.39	0.02
32	603381	永臻股份	1,444	40,227.55	0.01
33	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
34	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
35	688709	成都华微	1,045	19,614.65	0.01
36	688584	上海合晶	866	13,743.42	0.00
37	301538	骏鼎达	150	13,683.00	0.00
38	301566	达利凯普	576	9,648.00	0.00
39	301591	肯特股份	219	8,085.48	0.00
40	688695	中创股份	186	5,866.44	0.00
41	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
42	301502	华阳智能	138	5,217.78	0.00
43	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
44	001359	平安电工	184	3,792.24	0.00
45	603312	西典新能	130	3,294.20	0.00
46	603082	北自科技	107	3,154.36	0.00
47	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
48	603375	盛景微	72	2,799.36	0.00
49	001387	雪祺电气	173	2,634.79	0.00
50	603373	安邦护卫	88	2,419.12	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	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金
---	------	------	----------	-------

号				资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	20,080,344.00	2.64
2	300750	宁德时代	17,299,172.00	2.27
3	688408	中信博	14,930,087.99	1.96
4	605222	起帆电缆	14,661,665.00	1.93
5	603997	继峰股份	14,515,408.00	1.91
6	300286	安科瑞	13,430,796.00	1.76
7	601689	DR拓普集	13,199,261.00	1.73
8	002920	德赛西威	13,126,472.00	1.72
9	688212	澳华内镜	13,079,606.41	1.72
10	002714	牧原股份	11,885,728.00	1.56
11	601677	明泰铝业	9,527,762.00	1.25
12	688301	奕瑞科技	9,508,353.33	1.25
13	300627	华测导航	9,102,164.60	1.20
14	002487	大金重工	8,899,367.00	1.17
15	002422	科伦药业	8,449,889.50	1.11
16	000333	美的集团	8,230,266.00	1.08
17	603035	常熟汽饰	7,904,428.00	1.04
18	600690	海尔智家	7,903,612.00	1.04
19	688235	百济神州	7,752,865.26	1.02
20	600276	恒瑞医药	7,423,651.40	0.98

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	32,729,666.00	4.30

2	300286	安科瑞	19,835,244.00	2.61
3	002318	久立特材	19,000,001.00	2.50
4	600027	华电国际	18,979,500.00	2.49
5	601985	中国核电	17,534,634.00	2.30
6	002353	杰瑞股份	16,126,539.00	2.12
7	002028	思源电气	16,001,728.00	2.10
8	002371	北方华创	15,096,267.00	1.98
9	688008	澜起科技	14,902,508.42	1.96
10	600862	中航高科	12,959,017.00	1.70
11	002850	科达利	12,843,041.00	1.69
12	002179	中航光电	12,738,793.04	1.67
13	688037	芯源微	12,470,986.43	1.64
14	300054	鼎龙股份	12,307,589.00	1.62
15	002920	德赛西威	12,235,677.65	1.61
16	601126	四方股份	12,020,758.00	1.58
17	601816	京沪高铁	11,575,717.00	1.52
18	002837	英维克	10,637,261.50	1.40
19	002332	仙琚制药	10,001,991.00	1.31
20	600011	华能国际	8,927,317.00	1.17

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。

7.4.3 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	427,095,698.44
卖出股票收入（成交）总额	772,056,214.73

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	20,273,369.86	6.35
	其中：政策性金融债	20,273,369.86	6.35
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)	38,946,894.43	12.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,220,264.29	18.53

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	092318002	23农发清发02	200,000	20,273,369.86	6.35
2	118024	冠宇转债	70,000	7,675,778.08	2.40
3	123107	温氏转债	50,000	6,309,952.06	1.97
4	111000	起帆转债	50,000	5,744,246.58	1.80
5	123161	强联转债	55,530	5,461,276.61	1.71

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 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

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

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

7.12.2 本基金前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	128,184.13
2	应收清算款	2,609,944.27
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,201.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,760,329.89

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	------	--------------

1	118024	冠宇转债	7,675,778.08	2.40
2	123107	温氏转债	6,309,952.06	1.97
3	111000	起帆转债	5,744,246.58	1.80
4	123161	强联转债	5,461,276.61	1.71
5	127049	希望转2	5,175,128.77	1.62
6	127089	晶澳转债	4,865,127.40	1.52
7	113623	凤21转债	3,715,384.93	1.16

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不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
17,122	11,091.24	10,181,200.64	5.36%	179,722,948.99	94.64%

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	68,513.70	0.04%

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	0~10

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
本报告期期初基金份额总额	424,980,215.66
本报告期基金总申购份额	26,534,052.40
减：本报告期基金总赎回份额	261,610,118.43
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	189,904,149.63

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会且无决议。

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

报告期内，基金管理人的重大人事变动：2024年4月1日，范妍女士离任公司副总经理。2024年4月30日，吴莉芳女士离任公司副总经理兼财务负责人；同日，苏东升先生新任公司副总经理兼财务负责人。

报告期内，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

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人员均未受稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员均未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	69,287,425.67	5.83%	51,682.03	5.17%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	134,138,513.81	11.28%	100,058.40	10.00%	-
光大证券	2	89,133,684.13	7.49%	57,571.68	5.75%	-
国金证券	2	17,537,684.98	1.47%	13,081.53	1.31%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	304,735,317.37	25.62%	288,251.57	28.81%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	180,842,605.95	15.20%	171,061.08	17.10%	-
平安	2	-	-	-	-	-

证券						
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	111,978,469.44	9.41%	83,526.30	8.35%	-
西南证券	2	104,611,232.60	8.79%	67,571.58	6.75%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	36,318,724.26	3.05%	34,353.89	3.43%	-
中信建投	2	14,620,092.24	1.23%	13,828.87	1.38%	-
中信证券	2	126,278,529.41	10.62%	119,447.46	11.94%	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-

注1：截止本报告期末，本基金已有31个交易单元。本报告期内基金减少5个证券公司交易单元，为平安证券股份有限公司上交所及深交所交易单元、中信建投证券股份有限公司深交所交易单元、光大证券股份有限公司深交所交易单元和东方证券股份有限公司深交所交易单元。

注2：本基金管理人负责选择证券公司，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。选择租用证券公司基金交易单元的标准如下：

- （1）资金实力雄厚，财务状况良好；
- （2）经营行为稳健规范，在业内有良好的声誉；
- （3）内控制度健全，内部管理严格，具有良好的合规风控能力，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证券交易的需要，并能为基金管理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研究、服务能力和水平。

注3：基金选择证券公司交易单元的程序如下：

- （1）本基金管理人对证券公司的经营管理能力、资金及财务状况、合规风控能力、交易服务能力、研究服务能力等各项指标进行评价，经相应审批后确定选用交易单元的证券公司；
- （2）本基金管理人与被选中的证券公司签订交易单元租用协议。

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
华泰证券	9,691,227.29	9.99%	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	27,570,709.71	28.43%	773,200,000.00	14.31%	-	-	-	-
光大证券	-	-	929,200,000.00	17.20%	-	-	-	-
国金证券	216,976.63	0.22%	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	27,710,586.79	28.57%	1,114,710,000.00	20.63%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	28,061,888.66	28.93%	102,000,000.00	1.89%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	1,254,496.13	1.29%	161,000,000.00	2.98%	-	-	-	-
西南证券	674,622.73	0.70%	897,000,000.00	16.60%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	1,083,965.80	1.12%	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	715,000,000.00	13.23%	-	-	-	-
中信证券	722,934.24	0.75%	711,000,000.00	13.16%	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---	---	---

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2023年第四季度报告	证监会规定媒介	2024-01-22
2	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金招募说明书（更新）	证监会规定媒介	2024-02-29
3	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金2023年年度报告	证监会规定媒介	2024-03-29
4	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金经理变更的公告	证监会规定媒介	2024-04-03
5	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2024-04-03
6	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2024-04-03
7	圆信永丰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2024-04-03
8	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金2024年第一季度报告	证监会规定媒介	2024-04-22
9	圆信永丰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2024-04-30
10	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2024-06-28

§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、报告期内在规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

二〇二四年八月三十日