
圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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:2021 年 08 月 31 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2021年8月30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2021年1月1日起至2021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	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	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	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 中期财务会计报告(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	17
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
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	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	53
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54

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.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§ 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	655,484,442.62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	姓名	姓名
	兰文伟	郭明

露负责人	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
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 5号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道152 8号陆家嘴基金大厦19楼	北京市西城区复兴门内大街5 5号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		洪文瑾	陈四清

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 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
	本期已实现收益

本期利润	94,726,253.30
加权平均基金份额本期利润	0.1912
本期加权平均净值利润率	10.32%
本期基金份额净值增长率	9.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	599,517,863.79
期末可供分配基金份额利润	0.9146
期末基金资产净值	1,255,002,306.41
期末基金份额净值	1.9146
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	109.90%

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
过去一个月	1.25%	0.65%	-1.26%	0.53%	2.51%	0.12%
过去三个月	5.94%	0.77%	2.62%	0.64%	3.32%	0.13%
过去六个月	9.34%	1.17%	0.98%	0.86%	8.36%	0.31%
过去一年	52.94%	1.35%	17.44%	0.87%	35.50%	0.48%
过去三年	120.83%	1.28%	37.25%	0.89%	83.58%	0.39%

自基金合同生效起至今	109.90%	1.23%	20.14%	0.88%	89.76%	0.35%
------------	---------	-------	--------	-------	--------	-------

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-2021年06月30日)



§ 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2021年6月30日，公司旗下共管理26只开放式基金产品，包括2只股票型基金、17只混合型基金、6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		
范妍	本基金基金经理	2018- 01-29	-	13 年	复旦大学管理学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司副总经理兼首席投资官。历任兴业证券股份有限公司研究所行业与公司研究员，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研究部高级策略研究员，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。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。

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，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内（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占比分析。在一级市场证券申购和分配方面，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报价单进行核查，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。

4.3.2 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

报告期内，出于对于流动性剩余谨慎的判断，我上半年将整体股票组合的估值水平进行了一定的压降，同时压降了仓位。

2月份开始，我们观察到的消费数据开始低于预期；4月份开始，银行信贷投放出现了票据贴现较多的现象；5月份高频数据显示，水泥、建筑钢材反映出的基建地产投资需求偏弱。在这样的情况下，我们开始下修对于经济的预期，同时调整对于流动性的判断，并努力将投资范围向景气度相对较好而估值合理的行业集中。军工、TMT（半导体设备、消费电子、通信、计算机）、医药（偏自下而上选股，而非赛道股）、环保、金融地产、供给偏紧的周期性行业（建筑玻璃、造纸、钢铁、煤炭、部分化工细分行业等）是我们配置的主要方向。

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1.9146元，本报告期内，基金份额净值增长率为9.34%，同期业绩比较基准收益率为0.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在目前的政策框架下，我们对政府基建、房地产投资、房地产产业链现金流、消费复苏的力度持有相对谨慎的态度。流动性环境取决于海外资金对A股的配置比例、美联储政策转向的时间点，我们难以预判，只能进行密切跟踪。在这样的流动性和经济组合下，我们主要的配置方向仍会集中于估值合理，景气度较好的行业和公司，同时左侧布局企业价值被低估，景气度处于较低水平的行业。周期行业是上半年配置的一个方向，但供需平衡关系一旦恶化，我们可能会对其配置做出一定的调整。

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。

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2021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 中期财务会计报告(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：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,540,323.04	761,956.06
结算备付金		14,792,453.75	6,629,048.06
存出保证金		206,738.07	156,547.17
交易性金融资产	6.4.7.2	1,038,514,971.73	830,758,458.37
其中：股票投资		953,277,583.92	723,286,588.37
基金投资		-	-
债券投资		85,237,387.81	107,471,870.00
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	185,800,145.00	45,000,000.00
应收证券清算款		9,838,385.24	28,914,326.89
应收利息	6.4.7.5	1,278,621.30	607,423.80
应收股利		-	-
应收申购款		495,487.00	47,629.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,259,467,125.13	912,875,389.95
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,056,580.26	28,917,780.65
应付管理人报酬		1,429,163.29	1,106,524.49
应付托管费		190,555.12	147,536.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	565,763.29	342,811.64
应交税费		299.58	1,655.50
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	222,457.18	343,613.57
负债合计		4,464,818.72	30,859,922.46
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	655,484,442.62	503,677,943.56

未分配利润	6.4.7.10	599,517,863.79	378,337,523.93
所有者权益合计		1,255,002,306.41	882,015,467.49
负债和所有者权益总计		1,259,467,125.13	912,875,389.95

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.9146元，基金份额总额655,484,442.62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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
一、收入		104,623,801.73	227,924,398.13
1. 利息收入		1,770,887.07	1,089,815.68
其中：存款利息收入	6.4.7.11	106,510.89	101,353.62
债券利息收入		598,787.15	613,073.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,065,589.03	375,388.08
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		214,606,437.57	184,494,635.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	179,783,944.71	175,233,724.10
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	26,978,534.26	5,958,758.82
资产支持证券投资 收益	6.4.7.14. 3	-	-
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	7,843,958.60	3,302,152.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-112,004,373.92	41,155,465.44
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	250,851.01	1,184,481.36
减：二、费用		9,897,548.43	9,307,351.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,776,155.20	5,630,648.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	903,487.36	750,753.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	2,093,678.70	2,785,799.14
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		206.83	726.77
7. 其他费用	6.4.7.21	124,020.34	139,423.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		94,726,253.30	218,617,046.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		94,726,253.30	218,617,046.65

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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021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)	503,677,943.56	378,337,523.93	882,015,467.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	94,726,253.30	94,726,253.30
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)	151,806,499.06	126,454,086.56	278,260,585.62
其中: 1. 基金申购款	384,591,803.02	330,660,310.90	715,252,113.92
2. 基金赎回款	-232,785,303.96	-204,206,224.34	-436,991,528.30
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)	655,484,442.62	599,517,863.79	1,255,002,306.41
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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)	1,015,364,969.18	55,980,193.93	1,071,345,163.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	218,617,046.65	218,617,046.65
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)	-418,845,136.24	-54,019,361.93	-472,864,498.17

其中：1. 基金申购款	461,685,766.11	68,614,092.63	530,299,858.74
2. 基金赎回款	-880,530,902.35	-122,633,454.56	-1,003,164,356.91
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）	-	-36,904,765.41	-36,904,765.41
五、期末所有者权益（基金净值）	596,519,832.94	183,673,113.24	780,192,946.18

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：

蔡炎坤

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》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 \times 65%+上证国债指数收益率 \times 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2021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2021年6月30日的财务状况以及2021年中期的经营成果和基金净值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[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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021年06月30日	
活期存款	8,540,323.04	
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	8,540,323.04	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	904,606,563.31	953,277,583.92	48,671,020.61	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	54,763,285.72	51,198,387.81	-3,564,897.91
	银行间市场	34,033,090.90	34,039,000.00	5,909.10
	合计	88,796,376.62	85,237,387.81	-3,558,988.81
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	993,402,939.93	1,038,514,971.73	45,112,031.80	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

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 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	135,800,000.00	-
银行间市场	50,000,145.00	-
合计	185,800,145.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	1,097.77
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	5,990.94
应收债券利息	1,257,895.17
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	13,553.63
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	83.79
合计	1,278,621.30

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
	2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	565,463.29
银行间市场应付交易费用	300.00
合计	565,763.29

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	798.53
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	42,151.28
预提费用-信息披露费	179,507.37
合计	222,457.18

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	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	503,677,943.56	503,677,943.56
本期申购	384,591,803.02	384,591,803.02
本期赎回（以“-”号填列）	-232,785,303.96	-232,785,303.96
本期末	655,484,442.62	655,484,442.62

注：申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

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
上年度末	286,735,157.85	91,602,366.08	378,337,523.93
本期利润	206,730,627.22	-112,004,373.92	94,726,253.30
本期基金份额交易产生的变动数	175,588,196.73	-49,134,110.17	126,454,086.56
其中：基金申购款	357,457,459.05	-26,797,148.15	330,660,310.90
基金赎回款	-181,869,262.32	-22,336,962.02	-204,206,224.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	669,053,981.80	-69,536,118.01	599,517,863.79

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	29,364.87
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	75,793.95
其他	1,352.07
合计	106,510.89

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	696,407,963.68
减：卖出股票成本总额	516,624,018.97
买卖股票差价收入	179,783,944.71

6.4.7.13 基金投资收益

无。

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 2021年01月01日至2021年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	26,978,534.26
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	26,978,534.26

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 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	118,675,178.33
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	91,106,887.62
减：应收利息总额	589,756.45
买卖债券差价收入	26,978,534.26

6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	7,843,958.60
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	7,843,958.60

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-112,004,373.92
——股票投资	-98,620,657.25
——债券投资	-13,383,716.67
——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	-112,004,373.92

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	250,386.29
转换费收入	464.72
合计	250,851.01

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。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	2,093,368.70
银行间市场交易费用	310.00
合计	2,093,678.70

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	42,151.28
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,761.69
账户维护费	18,600.00
合计	124,020.34

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 2021年01月01日至202	上年度可比期间 2020年01月01日至202

	1年06月30日	0年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,776,155.20	5,630,648.48
其中：支付销售机构的客户维护费	1,058,033.48	2,349,702.58

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 2021年01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	903,487.36	750,753.16

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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-活期存款	8,540,323.04	29,364.87	4,747,192.92	56,129.41

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——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2021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
688696	极米科技	2021-02-23	2021-09-03	科创板打新限	133.73	779.94	1,252	167,429.96	976,484.88	-

				售						
688619	罗普特	2021-02-08	2021-08-23	科创板打新限售	19.31	26.73	5,856	113,079.36	156,530.88	-
688636	智明达	2021-03-30	2021-10-08	科创板打新限售	34.50	96.32	918	31,671.00	88,421.76	-
688662	富信科技	2021-03-25	2021-10-08	科创板打新限售	15.61	33.28	2,556	39,899.16	85,063.68	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	科创板打新限售	7.72	24.02	3,493	26,965.96	83,901.86	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	创业板打新限售	28.28	145.09	360	10,180.80	52,232.40	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-

3010 15	百洋 医药	2021 -06- 22	2021 -12- 30	创业 板打 新限 售	7.64	54.8 1	462	3,52 9.68	25,3 22.2 2	-
3010 09	可靠 股份	2021 -06- 08	2021 -12- 17	创业 板打 新限 售	12.5 4	31.2 2	801	10,0 44.5 4	25,0 07.2 2	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2021 -07- 06	新股 未上 市	9.46	9.46	2,609	24,6 81.1 4	24,6 81.1 4	-
3009 53	震裕 科技	2021 -03- 11	2021 -09- 22	创业 板打 新限 售	28.7 7	99.8 9	240	6,90 4.80	23,9 73.6 0	-
3009 41	创识 科技	2021 -02- 02	2021 -08- 09	创业 板打 新限 售	21.3 1	49.9 1	399	8,50 2.69	19,9 14.0 9	-
3009 68	格林 精密	2021 -04- 06	2021 -10- 15	创业 板打 新限 售	6.87	14.9 8	1,162	7,98 2.94	17,4 06.7 6	-
6882 26	威腾 电气	2021 -06- 28	2021 -07- 07	新股 未上 市	6.42	6.42	2,693	17,2 89.0 6	17,2 89.0 6	-
3010 13	利和 兴	2021 -06- 21	2021 -12- 29	创业 板打 新限 售	8.72	35.3 3	471	4,10 7.12	16,6 40.4 3	-
3006 14	百川 畅银	2021 -05- 18	2021 -11- 25	创业 板打 新限 售	9.19	49.6 1	329	3,02 3.51	16,3 21.6 9	-

300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	15.83	50.96	317	5,018.11	16,154.32	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	创业板打新限售	4.94	17.26	928	4,584.32	16,017.28	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	24.69	31.70	492	12,147.48	15,596.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	创业板打新限售	18.71	76.32	201	3,760.71	15,340.32	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	创业板打新限售	12.76	43.35	307	3,917.32	13,308.45	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	创业板打新限售	3.40	22.12	576	1,958.40	12,741.12	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	创业板打新限售	20.81	50.60	241	5,015.21	12,194.60	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	创业板打新限售	13.75	41.07	275	3,781.25	11,294.25	-
605287	德才股份	2021-06-	2021-07-	新股未上	31.56	31.56	349	11,014.4	11,014.4	-

		28	06	市				4	4	
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	创业板打新限售	16.53	46.05	232	3,834.96	10,683.60	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	创业板打新限售	6.79	34.76	301	2,043.79	10,462.76	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	创业板打新限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	创业板打新限售	7.81	28.94	312	2,436.72	9,029.28	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	4.56	18.87	474	2,161.44	8,944.38	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	创业板打新限售	13.00	27.39	216	2,808.00	5,916.24	-
300948	冠中生态	2021-06-04	2021-08-25	限售股送股	-	27.39	108	-	2,958.12	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	创业板打新限售	4.31	13.10	672	2,896.32	8,803.20	-
300961	深水海纳	2021-03-	2021-09-	创业板打	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-

		23	30	新限售						
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	创业板打新限售	8.41	39.12	219	1,841.79	8,567.28	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	创业板打新限售	5.48	17.07	492	2,696.16	8,398.44	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	创业板打新限售	24.90	27.29	295	7,345.50	8,050.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	创业板打新限售	4.54	15.34	507	2,301.78	7,777.38	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	创业板打新限售	14.20	44.02	175	2,485.00	7,703.50	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	创业板打新限售	7.19	16.20	430	3,091.70	6,966.00	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	创业板打新限售	13.39	30.08	217	2,905.63	6,527.36	-
3010	申菱	2021	2022	创业	8.29	8.29	782	6,48	6,48	-

18	环境	-06-28	-01-07	板打 新限售				2.78	2.78	
3010 07	德迈 仕	2021 -06- 04	2021 -12- 16	创业 板打 新限售	5.29	19.1 2	303	1,60 2.87	5,79 3.36	-
3009 98	宁波 方正	2021 -05- 25	2021 -12- 02	创业 板打 新限售	6.02	28.5 0	201	1,21 0.02	5,72 8.50	-
3009 95	奇德 新材	2021 -05- 17	2021 -11- 26	创业 板打 新限售	14.7 2	28.8 1	191	2,81 1.52	5,50 2.71	-
3009 60	通业 科技	2021 -03- 22	2021 -09- 29	创业 板打 新限售	12.0 8	23.0 6	234	2,82 6.72	5,39 6.04	-
3009 92	泰福 泵业	2021 -05- 17	2021 -11- 25	创业 板打 新限售	9.36	26.8 9	200	1,87 2.00	5,37 8.00	-
3010 10	晶雪 节能	2021 -06- 09	2021 -12- 20	创业 板打 新限售	7.83	22.6 2	218	1,70 6.94	4,93 1.16	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板打 新限售	10.6 4	10.6 4	421	4,47 9.44	4,47 9.44	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板打 新限售	9.46	9.46	290	2,74 3.40	2,74 3.40	-

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
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	3,200	320,000.00	320,000.00	-

注1: 根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股票，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票，采取集中竞价交易方式的，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1%，且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本基金持有该次非公开发行股票数量的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%。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。根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《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》的有关规定。

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。

注3: 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

注4: 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

注5：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。

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

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同责任，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。

于2021年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为1.76%。（2020年12月31日：7.09%）

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2021年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有185,800,145.00元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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%，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2021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0.17%。

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2021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1,241,985,450.89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 2021年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,540,323.04	-	-	-	8,540,323.04
结算备付金	14,792,453.75	-	-	-	14,792,453.75
存出保证金	206,738.07	-	-	-	206,738.07
交易性金融资产	85,237,387.81	-	-	953,277,583.92	1,038,514,971.73
买入返售金融资产	185,800,145.00	-	-	-	185,800,145.00
应收证券清算款	-	-	-	9,838,385.24	9,838,385.24
应收利息	-	-	-	1,278,621.30	1,278,621.30
应收申购款	-	-	-	495,487.00	495,487.00
资产总计	294,577,047.67	-	-	964,890,077.46	1,259,467,125.13
负债					
应付赎回	-	-	-	2,056,580.26	2,056,580.26

回款					
应付管理人报酬	-	-	-	1,429,163.29	1,429,163.29
应付托管费	-	-	-	190,555.12	190,555.12
应付交易费用	-	-	-	565,763.29	565,763.29
应交税费	-	-	-	299.58	299.58
其他负债	-	-	-	222,457.18	222,457.18
负债总计	-	-	-	4,464,818.72	4,464,818.72
利率敏感度缺口	294,577,047.67	-	-	960,425,258.74	1,255,002,306.41
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	761,956.06	-	-	-	761,956.06
结算备付金	6,629,048.06	-	-	-	6,629,048.06
存出保证金	156,547.17	-	-	-	156,547.17
交易性金融资产	44,963,100.00	49,953,370.00	12,555,400.00	723,286,588.37	830,758,458.37
买入返售金融资产	45,000,000.00	-	-	-	45,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	28,914,326.89	28,914,326.89
应收利息	-	-	-	607,423.80	607,423.80
应收申购款	-	-	-	47,629.60	47,629.60
资产总计	97,510,651.29	49,953,370.00	12,555,400.00	752,855,968.66	912,875,389.95
负债					
应付赎回	-	-	-	28,917,780.65	28,917,780.65

回款					
应付管理人报酬	-	-	-	1,106,524.49	1,106,524.49
应付托管费	-	-	-	147,536.61	147,536.61
应付交易费用	-	-	-	342,811.64	342,811.64
应交税费	-	-	-	1,655.50	1,655.50
其他负债	-	-	-	343,613.57	343,613.57
负债总计	-	-	-	30,859,922.46	30,859,922.46
利率敏感度缺口	97,510,651.29	49,953,370.00	12,555,400.00	721,996,046.20	882,015,467.49

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2021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资产净值的比例为6.79%(2020年12月31日：12.18%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020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，采用“自上而下”的策略，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 2021年06月30日		上年度末 2020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	953,277,583.92	75.96	723,286,588.37	82.00
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	953,277,583.92	75.96	723,286,588.37	82.00

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 沪深300指数上升5%	37,553,780.44	44,676,243.50
	2. 沪深300指数下降5%	-37,553,780.44	-44,676,243.50

6.4.14 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	953,277,583.92	75.69
	其中：股票	953,277,583.92	75.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	85,237,387.81	6.77
	其中：债券	85,237,387.81	6.77
	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	185,800,145.00	14.75
	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	23,332,776.79	1.85
8	其他各项资产	11,819,231.61	0.94
9	合计	1,259,467,125.13	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	19,186,490.70	1.53
B	采矿业	38,459,426.01	3.06
C	制造业	663,073,342.86	52.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	27,168.76	0.00
F	批发和零售业	42,665.04	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	10,836,000.00	0.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,038,963.24	5.26
J	金融业	83,690,662.09	6.67
K	房地产业	19,899,000.00	1.59
L	租赁和商务服务业	15,862,453.20	1.26
M	科学研究和技术服务业	10,514,000.00	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	25,634,391.63	2.04
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	953,277,583.92	75.96

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	000063	中兴通讯	1,000,074	33,232,459.02	2.65
2	600399	抚顺特钢	1,800,000	32,652,000.00	2.60
3	300253	卫宁健康	1,800,000	29,286,000.00	2.33
4	300054	鼎龙股份	1,600,000	29,200,000.00	2.33
5	300558	贝达药业	250,000	27,060,000.00	2.16
6	002179	中航光电	340,000	26,866,800.00	2.14
7	000830	鲁西化工	1,300,000	24,349,000.00	1.94
8	601636	旗滨集团	1,300,000	24,128,000.00	1.92
9	601601	中国太保	800,067	23,177,940.99	1.85
10	600521	华海药业	1,100,075	22,969,566.00	1.83
11	000739	普洛药业	780,071	22,934,087.40	1.83
12	300308	中际旭创	550,000	21,186,000.00	1.69
13	603236	移远通信	123,500	21,070,335.00	1.68
14	002299	圣农发展	800,069	19,105,647.72	1.52
15	601838	成都银行	1,500,000	18,960,000.00	1.51
16	600570	恒生电子	200,000	18,650,000.00	1.49
17	688037	芯源微	120,000	17,880,000.00	1.42
18	600030	中信证券	700,000	17,458,000.00	1.39
19	600862	中航高科	550,098	16,932,016.44	1.35
20	000002	万科A	700,000	16,667,000.00	1.33
21	603300	华铁应急	1,400,040	15,862,453.20	1.26
22	002371	北方华创	56,000	15,533,280.00	1.24
23	600426	华鲁恒升	500,000	15,475,000.00	1.23
24	600926	杭州银行	1,000,000	14,750,000.00	1.18
25	002025	航天电器	290,000	14,549,300.00	1.16
26	603588	高能环境	975,000	14,118,000.00	1.12
27	601677	明泰铝业	700,012	13,685,234.60	1.09
28	600183	生益科技	570,000	13,343,700.00	1.06
29	600497	驰宏锌锗	3,000,000	12,930,000.00	1.03
30	002541	鸿路钢构	220,900	12,889,515.00	1.03
31	601898	中煤能源	1,799,901	12,869,292.15	1.03

32	600985	淮北矿业	1,036,866	12,660,133.86	1.01
33	300463	迈克生物	300,000	12,627,000.00	1.01
34	002563	森马服饰	1,000,000	11,950,000.00	0.95
35	600019	宝钢股份	1,500,000	11,460,000.00	0.91
36	300567	精测电子	180,000	11,052,000.00	0.88
37	688002	睿创微纳	110,074	10,988,687.42	0.88
38	600029	南方航空	1,800,000	10,836,000.00	0.86
39	300114	中航电测	699,971	10,639,559.20	0.85
40	300132	青松股份	500,000	10,550,000.00	0.84
41	000710	贝瑞基因	350,000	10,514,000.00	0.84
42	300740	水羊股份	500,000	10,440,000.00	0.83
43	002212	天融信	500,000	9,885,000.00	0.79
44	300726	宏达电子	140,040	9,871,419.60	0.79
45	688608	恒玄科技	30,000	9,507,300.00	0.76
46	601939	建设银行	1,400,000	9,310,000.00	0.74
47	603658	安图生物	119,976	9,090,581.52	0.72
48	002415	海康威视	139,975	9,028,387.50	0.72
49	600166	福田汽车	2,600,000	8,970,000.00	0.71
49	002938	鹏鼎控股	250,000	8,970,000.00	0.71
51	300920	润阳科技	250,000	8,420,000.00	0.67
52	002557	洽洽食品	190,000	8,189,000.00	0.65
53	603337	杰克股份	300,000	8,019,000.00	0.64
54	603229	奥翔药业	230,000	7,679,700.00	0.61
55	600114	东睦股份	899,910	7,550,244.90	0.60
56	600989	宝丰能源	500,000	6,840,000.00	0.55
57	600323	瀚蓝环境	300,000	6,537,000.00	0.52
58	000488	晨鸣纸业	800,000	6,512,000.00	0.52
59	600282	南钢股份	1,800,000	6,408,000.00	0.51
60	002332	仙琚制药	500,000	6,270,000.00	0.50
61	603916	苏博特	300,000	6,192,000.00	0.49
62	603558	健盛集团	700,000	6,083,000.00	0.48

63	600295	鄂尔多斯	320,000	5,724,800.00	0.46
64	000977	浪潮信息	200,000	5,626,000.00	0.45
65	000959	首钢股份	900,000	5,058,000.00	0.40
66	601233	桐昆股份	200,000	4,818,000.00	0.38
67	603686	龙马环卫	300,000	4,563,000.00	0.36
68	603613	国联股份	39,980	3,996,800.60	0.32
69	300674	宇信科技	208,000	3,887,520.00	0.31
70	600823	世茂股份	800,000	3,232,000.00	0.26
71	601200	上海环境	250,000	2,992,500.00	0.24
72	603313	梦百合	73,855	2,219,342.75	0.18
73	300190	维尔利	300,000	1,953,000.00	0.16
74	600276	恒瑞医药	28,000	1,903,160.00	0.15
75	603267	鸿远电子	10,000	1,279,200.00	0.10
76	688696	极米科技	1,252	976,484.88	0.08
77	300973	立高食品	3,593	553,347.40	0.04
78	300997	欢乐家	9,279	172,682.04	0.01
79	688619	罗普特	5,856	156,530.88	0.01
80	300996	普联软件	2,410	134,504.51	0.01
81	688636	智明达	918	88,421.76	0.01
82	688662	富信科技	2,556	85,063.68	0.01
83	300985	致远新能	2,945	84,609.05	0.01
84	688533	上声电子	3,493	83,901.86	0.01
85	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
86	300972	万辰生物	4,300	73,065.60	0.01
87	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
88	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
89	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
90	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
91	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
92	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
93	301015	百洋医药	462	25,322.22	0.00

94	301009	可靠股份	801	25,007.22	0.00
95	300953	震裕科技	240	23,973.60	0.00
96	300941	创识科技	399	19,914.09	0.00
97	300968	格林精密	1,162	17,406.76	0.00
98	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
99	301013	利和兴	471	16,640.43	0.00
100	300614	百川畅银	329	16,321.69	0.00
101	300982	苏文电能	317	16,154.32	0.00
102	300932	三友联众	492	15,596.40	0.00
103	301002	崧盛股份	201	15,340.32	0.00
104	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
105	300940	南极光	307	13,308.45	0.00
106	300962	中金辐照	576	12,741.12	0.00
107	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
108	301016	雷尔伟	275	11,294.25	0.00
109	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
110	300955	嘉亨家化	232	10,683.60	0.00
111	300987	川网传媒	301	10,462.76	0.00
112	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
113	301004	嘉益股份	312	9,029.28	0.00
114	300945	曼卡龙	474	8,944.38	0.00
115	300948	冠中生态	324	8,874.36	0.00
116	300931	通用电梯	672	8,803.20	0.00
117	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
118	300950	德固特	219	8,567.28	0.00
119	300975	商络电子	492	8,398.44	0.00
120	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
121	300967	晓鸣股份	507	7,777.38	0.00
122	301011	华立科技	175	7,703.50	0.00
123	300927	江天化学	217	6,527.36	0.00
124	301007	德迈仕	303	5,793.36	0.00

125	300998	宁波方正	201	5,728.50	0.00
126	300995	奇德新材	191	5,502.71	0.00
127	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
128	300992	泰福泵业	200	5,378.00	0.00
129	301010	晶雪节能	218	4,931.16	0.00
130	605011	杭州热电	525	4,662.00	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

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601601	中国太保	31,248,025.41	3.54
2	300558	贝达药业	25,842,331.57	2.93
3	600521	华海药业	22,036,118.10	2.50
4	000063	中兴通讯	21,460,291.24	2.43
5	002299	圣农发展	21,377,655.54	2.42
6	600570	恒生电子	18,582,476.40	2.11
7	601838	成都银行	18,442,196.00	2.09
8	600926	杭州银行	17,863,862.13	2.03
9	300463	迈克生物	17,112,564.74	1.94
10	000739	普洛药业	16,863,178.06	1.91
11	300308	中际旭创	16,846,024.00	1.91
12	002179	中航光电	15,906,403.60	1.80
13	603588	高能环境	15,675,760.00	1.78
14	600399	抚顺特钢	15,446,168.00	1.75
15	600426	华鲁恒升	15,167,120.20	1.72
16	603658	安图生物	15,154,183.81	1.72
17	300253	卫宁健康	15,149,415.46	1.72
18	002025	航天电器	14,396,051.87	1.63
19	688037	芯源微	14,087,938.30	1.60

20	600497	驰宏锌锗	13,235,089.00	1.50
----	--------	------	---------------	------

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	300751	迈为股份	35,981,829.05	4.08
2	300450	先导智能	27,133,232.64	3.08
3	688388	嘉元科技	24,121,485.06	2.73
4	300014	亿纬锂能	21,582,003.75	2.45
5	600438	通威股份	21,082,136.00	2.39
6	002299	圣农发展	20,426,324.20	2.32
7	000100	TCL科技	20,146,358.00	2.28
8	000725	京东方A	18,809,410.00	2.13
9	688368	晶丰明源	18,007,851.08	2.04
10	600346	恒力石化	16,702,900.00	1.89
11	600399	抚顺特钢	16,328,947.00	1.85
12	002791	坚朗五金	15,879,948.00	1.80
13	603313	梦百合	15,197,047.44	1.72
14	600030	中信证券	14,810,562.00	1.68
15	002709	天赐材料	14,785,348.00	1.68
16	601966	玲珑轮胎	14,686,286.50	1.67
17	002179	中航光电	14,307,476.00	1.62
18	601233	桐昆股份	14,005,764.06	1.59
19	600276	恒瑞医药	13,523,620.76	1.53
20	600660	福耀玻璃	12,970,146.97	1.47

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	845,235,671.77
卖出股票收入（成交）总额	696,407,963.68

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	61,162,100.00	4.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,998,600.00	0.16
	其中：政策性金融债	1,998,600.00	0.16
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)	22,076,687.81	1.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	85,237,387.81	6.79

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019640	20国债10	221,000	22,100,000.00	1.76
2	200010	20付息国债10	200,000	20,002,000.00	1.59
3	128029	太阳转债	110,091	17,879,879.31	1.42
4	200015	20付息国债15	120,000	12,038,400.00	0.96

5	019645	20国债15	70,000	7,021,700.00	0.56
---	--------	--------	--------	--------------	------

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

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 通过查阅中国证监会、中国银保监会网站公开目录“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，不存在投资于超过基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	206,738.07
2	应收证券清算款	9,838,385.24
3	应收股利	-
4	应收利息	1,278,621.30
5	应收申购款	495,487.00

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,819,231.61

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	128029	太阳转债	17,879,879.31	1.42

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
42,149	15,551.60	457,135,410.94	69.74%	198,349,031.68	30.26%

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	54.34	0.00%
------------------	-------	-------

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、基金投资和研发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	503,677,943.56
本报告期基金总申购份额	384,591,803.02
减：本报告期基金总赎回份额	232,785,303.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	655,484,442.62

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

1、本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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	
华泰证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	112,670,106.33	7.40%	104,929.96	8.47%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	199,065,129.45	13.07%	145,576.68	11.75%	-
光大证券	2	66,031,076.14	4.34%	41,685.49	3.36%	-
国金证券	2	253,227,700.20	16.63%	185,184.78	14.94%	-
国泰	2	40,473,705.59	2.66%	37,690.90	3.04%	-

君安						
国信 证券	2	-	-	-	-	-
海通 证券	2	237,503,543.53	15.60%	221,186.71	17.85%	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	2	117,220,500.24	7.70%	109,167.11	8.81%	-
天风 证券	2	256,710,419.03	16.86%	187,732.12	15.15%	-
西南 证券	2	57,130,984.86	3.75%	36,067.48	2.91%	-
兴业 证券	2	9,832,381.70	0.65%	9,157.17	0.74%	-
招商 证券	2	131,217,424.54	8.62%	122,202.50	9.86%	-
中金 公司	2	-	-	-	-	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	41,713,161.98	2.74%	38,846.99	3.13%	-

注1：本报告期内基金无新增证券公司交易单元。

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。

10.7.2 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	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	8,150,827.12	5.55%	836,000,000.00	7.62%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	13,702,847.10	9.32%	-	-	-	-	-	-
光大证券	52,094,388.26	35.44%	-	-	-	-	-	-
国金证券	14,367,752.10	9.78%	2,685,100,000.00	24.47%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	221,000,000.00	2.01%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	16,883,348.90	11.49%	1,214,000,000.00	11.06%	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	9,084,00 6.90	6.1 8%	1,714,500, 000.00	15.6 2%	-	-	-	-
天风证券	8,188,29 8.09	5.5 7%	2,700,400, 000.00	24.6 1%	-	-	-	-
西南证券	16,663,8 76.80	11.3 4%	525,000,00 0.00	4.7 8%	-	-	-	-
兴业证券	699,887. 53	0.4 8%	467,000,00 0.00	4.2 6%	-	-	-	-
招商证券	7,148,75 4.56	4.8 6%	547,000,00 0.00	4.9 8%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	65,000,00 0.00	0.5 9%	-	-	-	-

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	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下基金参加蚂蚁基金基金转换费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-02-04
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	2021-02-22
3	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金2021年第一季度报告	证监会规定媒介	2021-04-22
4	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金托管协议更新	证监会规定媒介	2021-06-30
5	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金合同更新	证监会规定媒介	2021-06-30
6	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	2021-06-30

7	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	2021-06-30
8	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金增加侧袋机制并修订基金合同、托管协议的公告	证监会规定媒介	2021-06-30

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210203	203,741,545.38	82,380,363.05	151,678,399.32	134,443,509.11	20.51%
	2	20210521-20210630	203,741,545.38	82,380,363.05	151,678,399.32	134,443,509.11	20.51%
	3	20210119-20210307	88,417,656.80	0.00	0.00	88,417,656.80	13.49%
	4	20210308-20210513	0.00	105,948,086.35	0.00	105,948,086.35	16.16%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

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

二〇二一年八月三十一日