

---

# 圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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:2022 年 03 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2022年3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。

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
8.3 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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	72
8.7 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	73
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	73
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	73
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	73

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	73
8.12 投资组合报告附注.....	73
§9 基金份额持有人信息.....	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	75
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.....	75
§10 开放式基金份额变动.....	75
§11 重大事件揭示.....	75
11.1 基金份额持有人大会决议.....	75
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.....	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
11.4 基金投资策略的改变.....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
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.....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
11.8 其他重大事件.....	81
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	86
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.....	86
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
§13 备查文件目录.....	87
13.1 备查文件目录.....	87
13.2 存放地点.....	87
13.3 查阅方式.....	87

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金
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	1,503,917,937.18份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注国家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×60%+恒生指数收益率×5%+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，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
	联系电话	021-60366000
	电子邮箱	service@gtsfund.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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gtsfund.com.cn">http://www.gtsfund.com.cn</a>
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）	上海市浦东新区东育路588号前滩中心42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	2021年	2020年	2019年
本期已实现收益	448,523,479.10	194,098,244.77	30,795,641.33
本期利润	408,363,409.37	353,404,397.01	126,758,759.60
加权平均基金份额本期利润	0.3603	1.1558	0.3170
本期加权平均净值利润率	15.48%	69.35%	32.67%
本期基金份额净值增长率	17.27%	91.50%	35.66%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	1,750,672,758.45	441,905,896.70	22,333,235.65
期末可供分配基金份额利润	1.1641	0.7229	0.0984
期末基金资产净值	3,776,002,732.37	1,308,760,631.70	253,618,859.13
期末基金份额净值	2.5108	2.1410	1.1180
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	151.08%	114.10%	11.80%

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	6.26%	0.70%	1.45%	0.52%	4.81%	0.18%

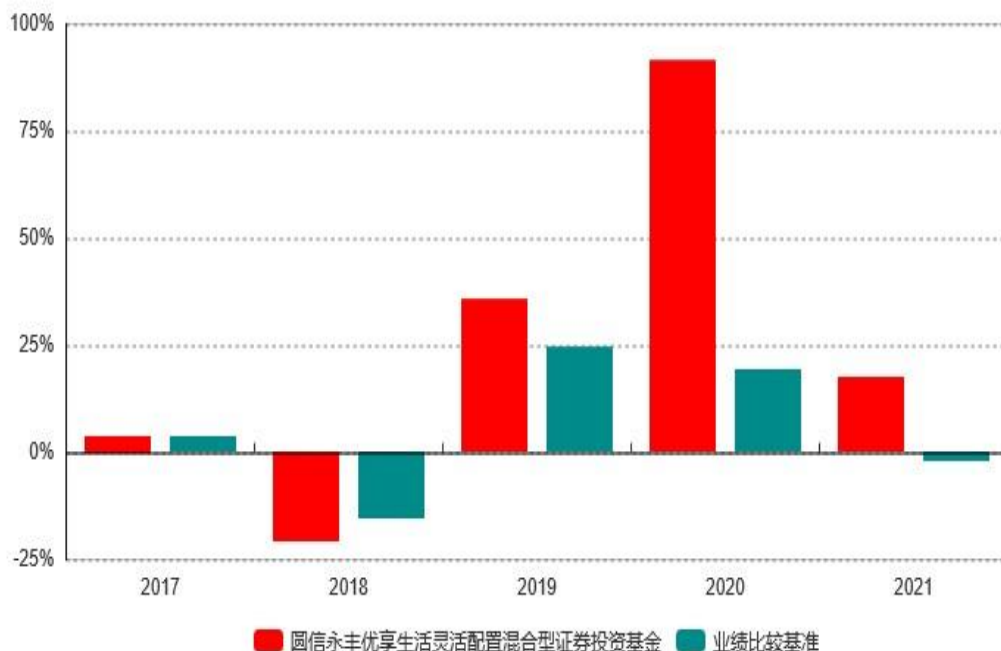
过去六个月	9.86%	0.86%	-2.52%	0.66%	12.38%	0.20%
过去一年	17.27%	1.05%	-1.57%	0.76%	18.84%	0.29%
过去三年	204.67%	1.28%	46.02%	0.84%	158.65%	0.44%
自基金合同生效起至今	151.08%	1.24%	27.97%	0.82%	123.11%	0.42%

### 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



### 3.2.3 过去五年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





注：本基金合同生效日为2017年8月30日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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2021年12月31日，公司旗下共管理28只开放式基金产品，包括3只股票型基金、18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	2017- 08-30	-	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相关的环节均得到公平对待。基金管理人各类基金资产、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。

#### 4.3.3 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

2021年全年，市场波动较大，消费、建材、新能源汽车、光伏、汽车零部件、军工等板块在不同的时间段内都有过一段优异的表现，但除了新能源板块，持续度都偏弱。

我们按照行业景气度（不单指需求，指供需两方的平衡）和估值水平，有选择性地进行了配置，尽量规避景气下行的板块。全年保持了8成左右的仓位。军工、TMT、医药、周期这四个方向是全年配置较多的板块。

##### 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2.5108元，本报告期内，基金份额净值增长率为17.27%，同期业绩比较基准收益率为-1.57%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

信心比黄金更重要。2022年宏观领域所面临的挑战并不比2021年小，比如欧美制裁俄罗斯带来的原材料及能源供应链的不稳定性，国内疫情反复对服务业和消费的伤害，地产下行对产业链的牵制……

虽然困难很多，内外部环境都充满挑战，但是相对其他国家来说，中国把供应链安全放在了非常重要的位置上，制造业比较优势突出。我们相对选择两条主线进行配置：一条是和经济相关度低和行业自身景气相关度高的板块；一条是供应存在瓶颈的周期类板块。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021年，基金管理人牢记“受人之托、代人理财”的初心，忠实履行“诚实守信、勤勉尽责”这一职业操守的底线。公司监察稽核工作以“提升合规服务、推进业务发展、保障稳健经营、提升内控水平、保障投资者合法权益”为总体目标，秉承以合规促进发展、以服务创造价值的理念，按照工作计划结合实际情况对公司各项业务进行全面的监察稽核工作，保障和促进公司各项业务合法合规运作。报告期内，基金管理人内部监察稽核工作贯穿三条主线：

1、紧抓员工行为、公平交易、利益冲突、营销规范等方面的日常监控，积极防范内幕交易，坚守合规底线不动摇。做好以事前防范为主的合规服务，积极避免合规风险；做好对高风险业务高频率的合规监控，及时发现合规风险。

2、迎合监管政策变化，动态调整合规风控工作。报告期内，基金管理人重视信用风险、流动性风险等投资风险的监督，并积极防范运营过程中的操作风险。针对风险控

制的需求和重点，加强事前风险识别，注重事中风险监控，强化事后稽核力度，提高工作水平。做好有重点的专项审计，针对性地发现内控薄弱环节。

3、及时跟踪行业监管动向，发布更新监管动态，结合新法规实施、新监管要求落实以及公司业务发展的实际情况，辅以外部专业机构的实务经验和专业优势，推动和完善公司相关制度流程的建立、健全，防范日常运作中的违规行为发生。提供多样化的合规培训，提高员工的合规意识；营造合规氛围，组织全员参与合规宣传培训活动。

报告期内，基金管理人各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施不断完善并积极发挥作用。本基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。我们将继续以合规运作和风险管理为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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2021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(2022)第21805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2021年12月31日的资产负债表,2021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

	<p>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2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>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。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无。</p>
<p>其他事项</p>	<p>无。</p>
<p>其他信息</p>	<p>无。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>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。</p>

## 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（包括披露）、结构和内容，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	张炯	张晓阳
会计师事务所的地址	上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼	
审计报告日期	2022-03-29	

## § 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：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	21,043,075.37	49,093,334.83
结算备付金		47,265,992.55	3,700,890.51
存出保证金		416,618.96	178,668.85
交易性金融资产	7.4.7.2	3,273,099,003.42	1,265,885,588.98
其中：股票投资		3,017,418,603.42	1,200,998,688.98
基金投资		-	-
债券投资		255,680,400.00	64,886,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	450,000,000.00	12,000,000.00
应收证券清算款		9,280,987.34	-
应收利息	7.4.7.5	3,166,100.12	807,988.29
应收股利		-	-

应收申购款		1,998,417.44	27,384,728.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,806,270,195.20	1,359,051,200.16
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		21,439,898.64	46,671,536.44
应付赎回款		1,655,423.24	1,092,684.44
应付管理人报酬		4,584,738.94	1,438,475.02
应付托管费		611,298.54	191,796.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,752,405.29	715,516.60
应交税费		1,072.51	0.04
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	222,625.67	180,559.25
负债合计		30,267,462.83	50,290,568.46
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,503,917,937.18	611,288,839.34
未分配利润	7.4.7.10	2,272,084,795.19	697,471,792.36
所有者权益合计		3,776,002,732.37	1,308,760,631.70
负债和所有者权益总计		3,806,270,195.20	1,359,051,200.16

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值2.5108元，基金份额总额1,503,917,937.18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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
<b>一、收入</b>		463,266,542.97	365,515,579.67
1. 利息收入		10,192,969.49	883,632.76
其中：存款利息收入	7.4.7.11	511,151.05	59,550.08
债券利息收入		3,463,280.27	586,828.65
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,218,538.17	237,254.03
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		490,858,523.76	205,187,153.42
其中：股票投资收益	7.4.7.12	462,742,188.62	200,753,743.59
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	2,134,842.79	1,347,668.69
资产支持证券投资 收益	7.4.7.14. 3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	25,981,492.35	3,085,741.14
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-40,160,069.73	159,306,152.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	2,375,119.45	138,641.25
<b>减：二、费用</b>		54,903,133.60	12,111,182.66
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	39,274,339.17	7,530,059.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,236,578.58	1,004,007.97
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	10,036,346.52	3,367,952.24
5. 利息支出		27,186.34	6,883.57
其中：卖出回购金融资产支出		27,186.34	6,883.57
6. 税金及附加		117.88	4.00
7. 其他费用	7.4.7.21	328,565.11	202,275.53
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		408,363,409.37	353,404,397.01
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		408,363,409.37	353,404,397.01

### 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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021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)	611,288,839.34	697,471,792.36	1,308,760,631.70
二、本期经营活动产生的基金净值	-	408,363,409.37	408,363,409.37

变动数(本期利润)			
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)	892,629,097.84	1,166,249,593.46	2,058,878,691.30
其中: 1. 基金申购款	1,649,290,416.77	2,159,570,092.19	3,808,860,508.96
2. 基金赎回款	-756,661,318.93	-993,320,498.73	-1,749,981,817.66
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)	1,503,917,937.18	2,272,084,795.19	3,776,002,732.37
项 目	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020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)	226,859,660.57	26,759,198.56	253,618,859.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	353,404,397.01	353,404,397.01
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)	384,429,178.77	317,308,196.79	701,737,375.56
其中: 1. 基金申购	558,628,312.33	378,015,818.07	936,644,130.40

款			
2. 基金赎回款	-174,199,133.56	-60,707,621.28	-234,906,754.84
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)	611,288,839.34	697,471,792.36	1,308,760,631.70

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：

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

## 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。

自2017年8月30日(基金合同生效日)至2021年12月15日,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 $\times$ 65%+上证国债指数收益率 $\times$ 35%。

根据本基金的基金管理人于2021年12月16日发布的《关于圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金第二次基金份额持有人大会决议生效的公告》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,自2021年12月16日起,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行市的股票(含主板、创业板、中小板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(简称“港股通标的股票”)、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)、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、公开发行的次级债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债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%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%;投资于同业存单的比例不超过基金资产的20%。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、国债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。股指期货、国债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 $\times$ 60%+恒生指数收益率 $\times$ 5%+上证国债指数收益率 $\times$ 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2022年3月29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2021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2021年12月31日的财务状况以及2021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。

#### 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 and 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或票面利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。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 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) 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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号-收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 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。

##### 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[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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	21,043,075.37	49,093,334.83
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	21,043,075.37	49,093,334.83

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,884,357,899.82	3,017,418,603.42	133,060,703.60	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	39,555,620.00	39,541,600.00	-14,020.00
	银行间市场	216,261,114.32	216,138,800.00	-122,314.32
	合计	255,816,734.32	255,680,400.00	-136,334.32
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,140,174,634.14	3,273,099,003.42	132,924,369.28	
项目	上年度末 2020年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	

股票		1,027,989,147.97	1,200,998,688.98	173,009,541.01
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	42,954,545.20	43,014,100.00	59,554.80
	银行间市场	21,857,456.80	21,872,800.00	15,343.20
	合计	64,812,002.00	64,886,900.00	74,898.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,092,801,149.97	1,265,885,588.98	173,084,439.01

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	450,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	450,000,000.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	12,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	12,000,000.00	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	2,003.22	547.96
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	21,341.79	1,665.40
应收债券利息	3,322,896.97	807,748.50
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-180,318.06	-2,053.97
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	176.20	80.40
合计	3,166,100.12	807,988.29

## 7.4.7.6 其他资产

无余额。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,751,855.29	715,341.60
银行间市场应付交易费用	550.00	175.00
合计	1,752,405.29	715,516.60

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------



	2021年12月31日	2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,625.67	559.25
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费	100,000.00	60,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	222,625.67	180,559.25

注：此处应付赎回费含应付转出费。

#### 7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	611,288,839.34	611,288,839.34
本期申购	1,649,290,416.77	1,649,290,416.77
本期赎回（以“-”号填列）	-756,661,318.93	-756,661,318.93
本期末	1,503,917,937.18	1,503,917,937.18

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	441,905,896.70	255,565,895.66	697,471,792.36
本期利润	448,523,479.10	-40,160,069.73	408,363,409.37
本期基金份额交易产生的变动数	860,243,382.65	306,006,210.81	1,166,249,593.46
其中：基金申购款	1,632,282,806.55	527,287,285.64	2,159,570,092.19
基金赎回款	-772,039,423.90	-221,281,074.83	-993,320,498.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,750,672,758.45	521,412,036.74	2,272,084,795.19

**7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	92,037.57	28,847.25
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	413,564.93	28,794.32
其他	5,548.55	1,908.51
合计	511,151.05	59,550.08

**7.4.7.12 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	2,956,348,941.84	977,317,490.10
减：卖出股票成本总额	2,493,606,753.22	776,563,746.51
买卖股票差价收入	462,742,188.62	200,753,743.59

**7.4.7.13 基金投资收益**

无。

**7.4.7.14 债券投资收益**
**7.4.7.14.1 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31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	2,134,842.79	1,347,668.69

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	2,134,842.79	1,347,668.69

## 7.4.7.14.2 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12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	163,349,106.07	50,873,945.03
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	157,979,602.00	48,680,246.95
减：应收利息总额	3,234,661.28	846,029.39
买卖债券差价收入	2,134,842.79	1,347,668.69

## 7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

无。

## 7.4.7.15 贵金属投资收益

无。

## 7.4.7.16 衍生工具收益

无。

## 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

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

	年12月31日	年12月31日
股票投资产生的股利收益	25,981,492.35	3,085,741.14
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	25,981,492.35	3,085,741.14

## 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-40,160,069.73	159,306,152.24
——股票投资	-39,948,837.41	159,273,174.24
——债券投资	-211,232.32	32,978.00
——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	-40,160,069.73	159,306,152.24

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
基金赎回费收入	1,832,597.18	138,099.34
转换费收入	542,522.27	541.91

合计	2,375,119.45	138,641.25
----	--------------	------------

注1：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

注2：本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	10,034,271.52	3,367,347.24
银行间市场交易费用	2,075.00	605.00
合计	10,036,346.52	3,367,952.24

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	100,000.00	59,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	10,565.11	5,275.53
账户维护费	18,000.00	18,000.00
基金持有人会议费用	20,000.00	-
律师费	60,000.00	-
合计	328,565.11	202,275.53

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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。

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 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12月31日	0年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	39,274,339.17	7,530,059.35
其中：支付销售机构的客户维护费	5,072,674.32	1,587,297.32

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,236,578.58	1,004,007.97

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年12月31日	2020年01月01日至 2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	11,915,755.09	0.00
报告期间申购/买入总份额	8,113,184.58	11,915,755.09
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	11,915,755.09	0.00
报告期末持有的基金份额	8,113,184.58	11,915,755.09
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.54%	1.95%

注1：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

注2：基金管理人圆信永丰基金公司在本年度申购/赎回本基金的交易委托圆信永丰直销柜台办理。

#### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2021年01月01日至2021年12月31日		2020年01月01日至2020年12月31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	21,043,075.37	92,037.57	49,093,334.83	28,847.25

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明



无。

#### 7.4.11 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。

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	上交所打新限售	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688385	复旦微电	2021-07-27	2022-02-07	科创板打新限售	6.23	48.49	8,986	55,982.78	435,731.14	-
688257	新锐股份	2021-10-19	2022-04-27	科创板打新限售	62.30	61.63	2,899	180,607.70	178,665.37	-
688793	倍轻松	2021-07-07	2022-01-17	科创板打新限售	27.40	101.41	1,454	39,839.60	147,450.14	-
600941	中国移动	2021-12-23	2022-01-05	新股未上市	57.58	57.58	1,000	57,580.00	57,580.00	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	60.64	234.57	233	14,129.12	54,654.81	-

				售						
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	创业板打新限售	116.88	122.05	436	50,959.68	53,213.80	-
688501	青达环保	2021-07-09	2022-01-17	科创板打新限售	10.57	21.05	1,759	18,592.63	37,026.95	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	创业板打新限售	22.04	56.23	644	14,193.76	36,212.12	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	创业板打新限售	10.45	12.19	2,764	28,883.80	33,693.16	-
301099	雅创电子	2021-11-10	2022-05-23	创业板打新限售	21.99	82.90	351	7,718.49	29,097.90	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	创业板打新限售	5.17	44.18	539	2,786.63	23,813.02	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	创业板打新限售	10.07	19.07	1,214	12,224.98	23,150.98	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	创业板打新限售	15.48	23.18	915	14,164.20	21,209.70	-
3011	风光	2021	2022	创业	27.8	34.5	599	16,6	20,7	-

00	股份	-12-10	-06-17	板打 新限售	1	7		58.1 9	07.4 3	
3010 93	华兰 股份	2021 -10- 21	2022 -05- 05	创业 板打 新限售	58.0 8	50.2 3	409	23,7 54.7 2	20,5 44.0 7	-
3010 18	申菱 环境	2021 -06- 28	2022 -01- 07	创业 板打 新限售	8.29	26.0 2	782	6,48 2.78	20,3 47.6 4	-
3009 94	久祺 股份	2021 -08- 02	2022 -02- 14	创业 板打 新限售	11.9 0	45.4 2	420	4,99 8.00	19,0 76.4 0	-
3010 60	兰卫 医学	2021 -09- 06	2022 -03- 14	创业 板打 新限售	4.17	30.9 3	587	2,44 7.79	18,1 55.9 1	-
3011 68	通灵 股份	2021 -12- 02	2022 -06- 10	创业 板打 新限售	39.0 8	54.8 6	329	12,8 57.3 2	18,0 48.9 4	-
3010 88	戎美 股份	2021 -10- 19	2022 -04- 28	创业 板打 新限售	33.1 6	24.9 9	704	23,3 44.6 4	17,5 92.9 6	-
3011 11	粤万 年青	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限售	10.4 8	43.9 3	379	3,97 1.92	16,6 49.4 7	-
3011 79	泽宇 智能	2021 -12- 01	2022 -06- 08	创业 板打 新限售	43.9 9	52.4 2	295	12,9 77.0 5	15,4 63.9 0	-

				售						
3011 38	华研 精机	2021 -12- 08	2022 -06- 15	创业 板打 新限 售	26.1 7	53.5 5	285	7,45 8.45	15,2 61.7 5	-
3010 46	能辉 科技	2021 -08- 10	2022 -02- 17	创业 板打 新限 售	8.34	48.9 6	290	2,41 8.60	14,1 98.4 0	-
3011 26	达嘉 维康	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限 售	12.3 7	21.3 5	662	8,18 8.94	14,1 33.7 0	-
3011 99	迈赫 股份	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限 售	29.2 8	33.5 0	402	11,7 70.5 6	13,4 67.0 0	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板打 新限 售	10.6 4	30.3 8	421	4,47 9.44	12,7 89.9 8	-
3010 26	浩通 科技	2021 -07- 08	2022 -01- 17	创业 板打 新限 售	18.0 3	62.6 8	203	3,66 0.09	12,7 24.0 4	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板打 新限 售	9.46	41.3 9	290	2,74 3.40	12,0 03.1 0	-
3010 78	孩子 王	2021 -09- 30	2022 -04- 14	创业 板打 新限 售	5.77	15.3 4	756	4,36 2.12	11,5 97.0 4	-
3010	争光	2021	2022	创业	36.3	35.5	323	11,7	11,4	-

92	股份	-10-21	-05-05	板打 新限售	1	2		28.1 3	72.9 6	
3010 48	金鹰 重工	2021 -08- 11	2022 -02- 28	创业 板打 新限售	4.13	12.9 5	843	3,48 1.59	10,9 16.8 5	-
3010 45	天禄 科技	2021 -08- 06	2022 -02- 17	创业 板打 新限售	15.8 1	28.3 6	335	5,29 6.35	9,50 0.60	-
3007 74	倍杰 特	2021 -07- 26	2022 -02- 16	创业 板打 新限售	4.57	21.0 7	444	2,02 9.08	9,35 5.08	-
3010 40	中环 海陆	2021 -07- 26	2022 -02- 07	创业 板打 新限售	13.5 7	38.4 5	241	3,27 0.37	9,26 6.45	-
3011 98	喜悦 智行	2021 -11- 25	2022 -06- 02	创业 板打 新限售	21.7 6	34.2 4	262	5,70 1.12	8,97 0.88	-
3010 62	上海 艾录	2021 -09- 07	2022 -03- 14	创业 板打 新限售	3.31	17.0 1	523	1,73 1.13	8,89 6.23	-
3010 52	果麦 文化	2021 -08- 23	2022 -02- 28	创业 板打 新限售	8.11	33.6 6	252	2,04 3.72	8,48 2.32	-
3010 25	读客 文化	2021 -07- 06	2022 -01- 24	创业 板打 新限售	1.55	20.8 4	403	624. 65	8,39 8.52	-

				售						
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	创业板打新限售	8.40	23.87	328	2,755.20	7,829.36	-
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	创业板打新限售	12.95	18.33	403	5,218.85	7,386.99	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	创业板打新限售	15.14	59.93	108	1,635.12	6,472.44	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	19.34	32.88	196	3,790.64	6,444.48	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	创业板打新限售	4.97	12.50	513	2,549.61	6,412.50	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	创业板打新限售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	创业板打新限售	9.08	15.23	416	3,777.28	6,335.68	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	创业板打新限售	23.38	29.91	205	4,792.90	6,131.55	-
3010	金百	2021	2022	创业	7.31	28.1	215	1,57	6,05	-

41	泽	-08-02	-02-11	板打 新限售		8		1.65	8.70	
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	创业 板打 新限售	7.46	33.38	181	1,350.26	6,041.78	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	创业 板打 新限售	9.96	27.28	203	2,021.88	5,537.84	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	创业 板打 新限售	17.40	36.13	153	2,662.20	5,527.89	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股 未上 市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	创业 板打 新限售	6.68	20.22	266	1,776.88	5,378.52	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	创业 板打 新限售	8.09	19.29	259	2,095.31	4,996.11	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	创业 板打 新限售	11.45	16.63	286	3,274.70	4,756.18	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	创业 板打 新限售	14.82	24.24	193	2,860.26	4,678.32	-

301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	创业板打新限售	12.24	32.06	144	1,762.56	4,616.64	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	创业板打新限售	11.87	28.77	155	1,839.85	4,459.35	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	创业板打新限售	8.03	19.01	218	1,750.54	4,144.18	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	创业板打新限售	13.98	28.36	144	2,013.12	4,083.84	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	创业板打新限售	11.92	29.17	140	1,668.80	4,083.80	-
301136	招标股份	2021-12-31	2022-01-11	创业板打新限售	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-

## 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
113052	兴业转债	2021-12-29	2022-01-14	新债未上市	100.00	100.00	35,490	3,549.00	3,549.00	-

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份，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%。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份，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份不适用《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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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。本基金重点关注国家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。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或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（简称“港股通标的股票”）、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）、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、公开发行的次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债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

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	186,919,900.00	64,828,900.00
合计	186,919,900.00	64,828,900.00

注：未评级部分为国债、政策性金融债和短期融资券。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

##### 7.4.13.2.4 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	3,549,000.00	1,000.00
AAA以下	-	57,000.00
未评级	65,211,500.00	-
合计	68,760,500.00	58,000.00

注：未评级部分为国债和政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

#### 7.4.13.3 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12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 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7.4.12。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12月31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0.18%。

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12月31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3,742,543,694.17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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2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	21,043,075.37	-	-	-	21,043,075.37
结算备付金	47,265,992.55	-	-	-	47,265,992.55
存出保证金	416,618.96	-	-	-	416,618.96
交易性金融资产	255,680,400.00	-	-	3,017,418,603.42	3,273,099,003.42
买入返售金融资产	450,000,000.00	-	-	-	450,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	9,280,987.34	9,280,987.34
应收利息	-	-	-	3,166,100.12	3,166,100.12
应收申购款	-	-	-	1,998,417.44	1,998,417.44
资产总计	774,406,086.88	-	-	3,031,864,108.32	3,806,270,195.20
负债					
应付证券清算款	-	-	-	21,439,898.64	21,439,898.64
应付赎回款	-	-	-	1,655,423.24	1,655,423.24
应付管理人报酬	-	-	-	4,584,738.94	4,584,738.94
应付托管费	-	-	-	611,298.54	611,298.54

应付交易费用	-	-	-	1,752,405.29	1,752,405.29
应交税费	-	-	-	1,072.51	1,072.51
其他负债	-	-	-	222,625.67	222,625.67
负债总计	-	-	-	30,267,462.83	30,267,462.83
利率敏感度缺口	774,406,086.88	-	-	3,001,596,645.49	3,776,002,732.37
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	49,093,334.83	-	-	-	49,093,334.83
结算备付金	3,700,890.51	-	-	-	3,700,890.51
存出保证金	178,668.85	-	-	-	178,668.85
交易性金融资产	64,828,900.00	-	58,000.00	1,200,998,688.98	1,265,885,588.98
买入返售金融资产	12,000,000.00	-	-	-	12,000,000.00
应收利息	-	-	-	807,988.29	807,988.29
应收申购款	-	-	-	27,384,728.70	27,384,728.70
资产总计	129,801,794.19	-	58,000.00	1,229,191,405.97	1,359,051,200.16
负债					
应付证券清算款	-	-	-	46,671,536.44	46,671,536.44
应付赎回款	-	-	-	1,092,684.44	1,092,684.44
应付管理人报酬	-	-	-	1,438,475.02	1,438,475.02
应付托管费	-	-	-	191,796.67	191,796.67

应付交易费用	-	-	-	715,516.60	715,516.60
应交税费	-	-	-	0.04	0.04
其他负债	-	-	-	180,559.25	180,559.25
负债总计	-	-	-	50,290,568.46	50,290,568.46
利率敏感度缺口	129,801,794.19	-	58,000.00	1,178,900,837.51	1,308,760,631.70

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31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6.77% (2020年12月31日：4.96%)，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)。

#### 7.4.13.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	25,472,328.00	-	25,472,328.00
资产合计	-	25,472,328.00	-	25,472,328.00
以外币计价的负债				



负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	25,472,328.00	-	25,472,328.00
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值5%	1,273,616.40	0.00
	2. 所有外币相对人民币贬值5%	-1,273,616.40	0.00

#### 7.4.13.4.3 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。本基金投资组合中，股票资产占基金资产的0%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的20%。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、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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。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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	3,017,418,603.42	79.91	1,200,998,688.98	91.77
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	3,017,418,603.42	79.91	1,200,998,688.98	91.77

## 7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1. 沪深300指数上升5%	105,324,613.44	72,307,272.18
	2. 沪深300指数下降5%	-105,324,613.44	-72,307,272.18

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## (1) 公允价值

## (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于2021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3,014,047,982.18元，属于第二层次的余额为255,818,933.93元，属于第三层次的余额为3,232,087.31元(2020年12月31日：第一层次1,190,136,481.20元，第二层次75,749,107.78元，无第三层次)。

## (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

于2021年12月31日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具3,232,087.31元(2020年12月31日：无)。于2021年度，本基金购买第三层次的金融工具2,466,848.92元，计入当期损益的利得或损失(公允价值变动损益等项目)的金额为765,238.39元

(2020年度：无)，2021年12月31日仍持有的第三层次金融工具计入2021年度损益的未实现利得或损失金额为765,238.39元(2020年度：无)。于2021年12月31日，上述第三层次金融工具均为股票投资，公允价值为3,232,087.31元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021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(2020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) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，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	3,017,418,603.42	79.27
	其中：股票	3,017,418,603.42	79.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	255,680,400.00	6.72
	其中：债券	255,680,400.00	6.72

	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	450,000,000.00	11.82
	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	68,309,067.92	1.79
8	其他各项资产	14,862,123.86	0.39
9	合计	3,806,270,195.20	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币25,472,328.00元，占期末净值比例为0.67%。

## 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	53,174,000.00	1.41
B	采矿业	62,883,000.00	1.67
C	制造业	2,150,647,994.24	56.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	95,412,000.00	2.53
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	125,635.40	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	26,598,000.00	0.70
H	住宿和餐饮业	4,616.64	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	211,670,682.63	5.61
J	金融业	137,966,282.04	3.65
K	房地产业	80,498,955.00	2.13
L	租赁和商务服务业	51,110,000.00	1.35
M	科学研究和技术服务业	17,559,316.94	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	104,256,041.98	2.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,155.91	0.00
R	文化、体育和娱乐业	16,880.84	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,991,946,275.42	79.24

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
电信服务	17,672,424.00	0.47
基础材料	7,799,904.00	0.21
合计	25,472,328.00	0.67

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3 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	300054	鼎龙股份	4,400,000	107,096,000.00	2.84
2	000063	中兴通讯	2,800,000	93,800,000.00	2.48
3	601677	明泰铝业	1,900,000	83,771,000.00	2.22
4	600521	华海药业	3,300,085	71,479,841.10	1.89
5	300253	卫宁健康	4,100,003	68,716,050.28	1.82
6	002179	中航光电	660,000	66,369,600.00	1.76
7	300558	贝达药业	750,032	59,875,054.56	1.59
8	600862	中航高科	1,610,000	57,573,600.00	1.52
9	300308	中际旭创	1,350,000	57,375,000.00	1.52
10	003816	中国广核	18,000,000	56,340,000.00	1.49

11	002299	圣农发展	2,200,000	53,174,000.00	1.41
12	603588	高能环境	3,000,060	52,711,054.20	1.40
13	603300	华铁应急	3,800,000	51,110,000.00	1.35
14	300567	精测电子	694,196	50,280,616.28	1.33
15	600426	华鲁恒升	1,600,000	50,080,000.00	1.33
16	603613	国联股份	460,000	49,450,000.00	1.31
17	002028	思源电气	1,000,000	49,210,000.00	1.30
18	002371	北方华创	140,000	48,582,800.00	1.29
19	600399	抚顺特钢	1,900,000	47,063,000.00	1.25
20	600519	贵州茅台	22,000	45,100,000.00	1.19
21	600030	中信证券	1,700,000	44,897,000.00	1.19
22	600570	恒生电子	700,020	43,506,243.00	1.15
23	601601	中国太保	1,600,000	43,392,000.00	1.15
24	300726	宏达电子	420,000	42,025,200.00	1.11
25	688037	芯源微	239,991	40,510,480.80	1.07
26	600048	保利发展	2,500,000	39,075,000.00	1.03
27	600483	福能股份	2,400,000	39,072,000.00	1.03
28	002241	歌尔股份	700,019	37,871,027.90	1.00
29	600323	瀚蓝环境	1,800,031	37,764,650.38	1.00
30	002001	新和成	1,200,060	37,345,867.20	0.99
31	002415	海康威视	699,925	36,620,076.00	0.97
32	002318	久立特材	2,000,000	35,760,000.00	0.95
33	000002	万科A	1,800,000	35,568,000.00	0.94
34	300638	广和通	648,236	35,328,862.00	0.94
35	002541	鸿路钢构	650,026	34,802,392.04	0.92
36	002332	仙琚制药	2,600,000	34,320,000.00	0.91
37	601126	四方股份	1,600,055	33,441,149.50	0.89
38	600183	生益科技	1,400,000	32,970,000.00	0.87
39	603379	三美股份	1,400,099	31,894,255.22	0.84
40	600497	驰宏锌锗	6,200,000	30,938,000.00	0.82
41	603260	合盛硅业	230,062	30,361,282.14	0.80

42	300841	康华生物	140,000	29,780,800.00	0.79
43	002938	鹏鼎控股	700,000	29,701,000.00	0.79
44	600166	福田汽车	8,600,004	29,584,013.76	0.78
45	300502	新易盛	740,048	28,995,080.64	0.77
46	601636	旗滨集团	1,600,000	27,360,000.00	0.72
47	002120	韵达股份	1,300,000	26,598,000.00	0.70
48	600038	中直股份	330,000	26,499,000.00	0.70
49	600160	巨化股份	2,000,000	25,820,000.00	0.68
50	002475	立讯精密	500,000	24,600,000.00	0.65
51	600036	招商银行	500,000	24,355,000.00	0.64
52	002568	百润股份	395,180	23,643,619.40	0.63
53	600188	兖矿能源	1,000,000	23,530,000.00	0.62
54	603337	杰克股份	1,001,400	23,482,830.00	0.62
55	002557	洽洽食品	380,200	23,329,072.00	0.62
56	300920	润阳科技	650,097	22,168,307.70	0.59
57	300463	迈克生物	750,047	21,893,871.93	0.58
58	688611	杭州柯林	300,000	21,231,000.00	0.56
59	688002	睿创微纳	270,062	21,218,771.34	0.56
60	002212	天融信	1,100,040	21,087,766.80	0.56
61	300604	长川科技	350,000	20,125,000.00	0.53
62	002013	中航机电	1,100,000	19,998,000.00	0.53
63	603345	安井食品	110,081	18,799,633.18	0.50
64	600282	南钢股份	5,000,000	18,500,000.00	0.49
65	688122	西部超导	190,000	18,418,600.00	0.49
66	600019	宝钢股份	2,500,000	17,900,000.00	0.47
67	H01024	快手-W	300,000	17,672,424.00	0.47
68	000710	贝瑞基因	899,976	17,459,534.40	0.46
69	603558	健盛集团	1,400,000	16,492,000.00	0.44
70	603893	瑞芯微	120,000	16,428,000.00	0.44
71	002563	森马服饰	2,100,000	16,233,000.00	0.43
72	603658	安图生物	290,020	15,968,501.20	0.42



73	000630	铜陵有色	4,500,000	15,660,000.00	0.41
74	002088	鲁阳节能	600,020	15,600,520.00	0.41
75	600114	东睦股份	1,300,000	15,275,000.00	0.40
76	688018	乐鑫科技	80,007	15,204,530.28	0.40
77	601233	桐昆股份	700,000	14,826,000.00	0.39
78	300132	青松股份	1,300,000	14,677,000.00	0.39
79	301002	崧盛股份	270,001	14,526,053.80	0.38
80	300034	钢研高纳	250,000	14,400,000.00	0.38
81	600295	鄂尔多斯	600,053	14,155,250.27	0.37
82	600926	杭州银行	1,100,022	14,102,282.04	0.37
83	603686	龙马环卫	900,000	12,924,000.00	0.34
84	600171	上海贝岭	500,000	12,830,000.00	0.34
85	300674	宇信科技	500,026	11,950,621.40	0.32
86	300114	中航电测	640,000	11,315,200.00	0.30
87	601838	成都银行	935,000	11,220,000.00	0.30
88	000822	山东海化	1,500,000	10,425,000.00	0.28
89	000959	首钢股份	1,800,000	10,314,000.00	0.27
90	300630	普利制药	180,000	9,907,200.00	0.26
91	300855	图南股份	140,000	9,868,600.00	0.26
92	688510	航亚科技	338,211	9,831,793.77	0.26
93	603229	奥翔药业	250,000	9,102,500.00	0.24
94	601200	上海环境	700,000	8,813,000.00	0.23
95	000968	蓝焰控股	900,000	8,415,000.00	0.22
96	688196	卓越新能	135,145	7,896,522.35	0.21
97	603192	汇得科技	143,300	7,861,438.00	0.21
98	H00826	天工国际	2,000,000	7,799,904.00	0.21
99	600165	新日恒力	500,000	6,715,000.00	0.18
100	600383	金地集团	451,500	5,855,955.00	0.16
101	300190	维尔利	800,000	4,880,000.00	0.13
102	300969	恒帅股份	20,000	2,001,600.00	0.05
103	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.04

104	688385	复旦微电	8,986	435,731.14	0.01
105	688257	新锐股份	2,899	178,665.37	0.00
106	688793	倍轻松	1,454	147,450.14	0.00
107	603313	梦百合	6,412	110,991.72	0.00
108	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
109	000888	峨眉山 A	10,000	66,000.00	0.00
110	600941	中国移动	1,000	57,580.00	0.00
111	301050	雷电微力	233	54,654.81	0.00
112	301177	迪阿股份	436	53,213.80	0.00
113	688501	青达环保	1,759	37,026.95	0.00
114	301035	润丰股份	644	36,212.12	0.00
115	301090	华润材料	2,764	33,693.16	0.00
116	301099	雅创电子	351	29,097.90	0.00
117	301069	凯盛新材	539	23,813.02	0.00
118	301149	隆华新材	1,214	23,150.98	0.00
119	301082	久盛电气	915	21,209.70	0.00
120	301100	风光股份	599	20,707.43	0.00
121	301093	华兰股份	409	20,544.07	0.00
122	301018	申菱环境	782	20,347.64	0.00
123	300994	久祺股份	420	19,076.40	0.00
124	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
125	301060	兰卫医学	587	18,155.91	0.00
126	301168	通灵股份	329	18,048.94	0.00
127	301088	戎美股份	704	17,592.96	0.00
128	301111	粤万年青	379	16,649.47	0.00
129	301179	泽宇智能	295	15,463.90	0.00
130	301138	华研精机	285	15,261.75	0.00
131	301046	能辉科技	290	14,198.40	0.00
132	301126	达嘉维康	662	14,133.70	0.00
133	301199	迈赫股份	402	13,467.00	0.00
134	301020	密封科技	421	12,789.98	0.00

135	301026	浩通科技	203	12,724.04	0.00
136	301021	英诺激光	290	12,003.10	0.00
137	301078	孩子王	756	11,597.04	0.00
138	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
139	301048	金鹰重工	843	10,916.85	0.00
140	301045	天禄科技	335	9,500.60	0.00
141	300774	倍杰特	444	9,355.08	0.00
142	301040	中环海陆	241	9,266.45	0.00
143	301198	喜悦智行	262	8,970.88	0.00
144	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
145	301052	果麦文化	252	8,482.32	0.00
146	301025	读客文化	403	8,398.52	0.00
147	300814	中富电路	328	7,829.36	0.00
148	301081	严牌股份	403	7,386.99	0.00
149	301033	迈普医学	108	6,472.44	0.00
150	301049	超越科技	196	6,444.48	0.00
151	301032	新柴股份	513	6,412.50	0.00
152	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
153	301083	百胜智能	416	6,335.68	0.00
154	301036	双乐股份	205	6,131.55	0.00
155	301041	金百泽	215	6,058.70	0.00
156	301072	中捷精工	181	6,041.78	0.00
157	300854	中兰环保	203	5,537.84	0.00
158	301063	海锅股份	153	5,527.89	0.00
159	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
160	301038	深水规院	266	5,378.52	0.00
161	301059	金三江	259	4,996.11	0.00
162	301027	华蓝集团	286	4,756.18	0.00
163	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
164	301037	保立佳	193	4,678.32	0.00
165	301073	君亭酒店	144	4,616.64	0.00

166	301053	远信工业	155	4,459.35	0.00
167	301057	汇隆新材	218	4,144.18	0.00
168	301068	大地海洋	144	4,083.84	0.00
169	301079	邵阳液压	140	4,083.80	0.00

#### 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	300558	贝达药业	76,024,129.79	5.81
2	000063	中兴通讯	73,417,367.25	5.61
3	600521	华海药业	72,756,327.40	5.56
4	600426	华鲁恒升	72,540,283.87	5.54
5	601838	成都银行	65,739,137.09	5.02
6	002299	圣农发展	65,699,294.76	5.02
7	600926	杭州银行	63,034,159.34	4.82
8	601601	中国太保	58,668,292.23	4.48
9	300253	卫宁健康	58,322,690.67	4.46
10	600862	中航高科	57,406,251.72	4.39
11	601677	明泰铝业	56,008,183.28	4.28
12	002078	太阳纸业	54,471,984.08	4.16
13	600399	抚顺特钢	54,208,544.00	4.14
14	002179	中航光电	54,150,115.93	4.14
15	300054	鼎龙股份	53,068,227.90	4.05
16	603613	国联股份	51,722,193.69	3.95
17	003816	中国广核	51,497,721.00	3.93
18	300772	运达股份	50,689,423.29	3.87
19	600188	兖矿能源	48,795,357.00	3.73
20	688037	芯源微	48,747,662.23	3.72
21	000002	万科A	47,943,628.39	3.66

22	600323	瀚蓝环境	47,880,900.84	3.66
23	600570	恒生电子	47,874,359.06	3.66
24	600519	贵州茅台	47,033,881.00	3.59
25	688002	睿创微纳	46,144,770.01	3.53
26	300308	中际旭创	45,227,695.97	3.46
27	688018	乐鑫科技	44,494,429.88	3.40
28	300726	宏达电子	44,135,116.30	3.37
29	300567	精测电子	43,197,006.12	3.30
30	600038	中直股份	42,191,122.00	3.22
31	002028	思源电气	42,164,011.36	3.22
32	002371	北方华创	41,997,617.11	3.21
33	002415	海康威视	41,612,803.53	3.18
34	603260	合盛硅业	41,334,339.19	3.16
35	603379	三美股份	40,381,874.76	3.09
36	600483	福能股份	39,520,068.00	3.02
37	002001	新 和 成	39,283,844.89	3.00
38	002025	航天电器	39,016,486.49	2.98
39	603501	韦尔股份	38,689,061.36	2.96
40	600166	福田汽车	38,504,504.08	2.94
41	300114	中航电测	37,125,000.37	2.84
42	002318	久立特材	36,637,677.98	2.80
43	002120	韵达股份	36,326,266.00	2.78
44	600171	上海贝岭	36,111,206.16	2.76
45	603300	华铁应急	35,935,451.40	2.75
46	601126	四方股份	35,347,893.69	2.70
47	603236	移远通信	35,325,107.83	2.70
48	300638	广和通	35,323,349.44	2.70
49	600019	宝钢股份	35,249,733.22	2.69
50	603229	奥翔药业	34,519,967.83	2.64
51	002475	立讯精密	34,476,856.83	2.63
52	600048	保利发展	34,373,544.00	2.63

53	603588	高能环境	34,294,090.21	2.62
54	600497	驰宏锌锗	33,736,165.53	2.58
55	002557	洽洽食品	33,298,887.47	2.54
56	688608	恒玄科技	33,014,295.70	2.52
57	600029	南方航空	31,866,945.00	2.43
58	600282	南钢股份	31,814,099.00	2.43
59	300841	康华生物	31,679,994.50	2.42
60	000710	贝瑞基因	31,404,023.92	2.40
61	603337	杰克股份	30,900,686.55	2.36
62	002241	歌尔股份	30,636,952.89	2.34
63	603363	傲农生物	30,258,205.19	2.31
64	000739	普洛药业	29,451,214.60	2.25
65	000830	鲁西化工	29,229,938.57	2.23
66	002013	中航机电	28,863,475.99	2.21
67	002541	鸿路钢构	28,647,770.04	2.19
68	600160	巨化股份	28,076,090.44	2.15
69	300920	润阳科技	27,597,753.74	2.11
70	601636	旗滨集团	27,263,244.00	2.08
71	000876	新希望	26,874,016.12	2.05
72	688408	中信博	26,554,154.11	2.03

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。

#### 8.4.2 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	600399	抚顺特钢	83,770,757.40	6.40
2	300772	运达股份	82,676,434.67	6.32
3	603236	移远通信	71,639,490.34	5.47
4	000739	普洛药业	62,947,128.15	4.81

5	000830	鲁西化工	59,661,975.12	4.56
6	601838	成都银行	58,197,082.05	4.45
7	600926	杭州银行	53,211,895.34	4.07
8	002078	太阳纸业	52,880,615.71	4.04
9	300751	迈为股份	51,296,738.44	3.92
10	002025	航天电器	46,828,733.97	3.58
11	601636	旗滨集团	46,380,652.52	3.54
12	603501	韦尔股份	45,581,513.85	3.48
13	600029	南方航空	42,099,632.18	3.22
14	600438	通威股份	41,265,844.42	3.15
15	688002	睿创微纳	40,498,048.90	3.09
16	002179	中航光电	40,430,685.26	3.09
17	000100	TCL科技	37,658,503.00	2.88
18	300450	先导智能	37,588,199.24	2.87
19	603229	奥翔药业	36,986,118.12	2.83
20	688388	嘉元科技	34,446,267.46	2.63
21	002299	圣农发展	34,283,981.00	2.62
22	300014	亿纬锂能	34,014,900.22	2.60
23	688368	晶丰明源	33,973,673.95	2.60
24	000725	京东方A	33,802,011.00	2.58
25	600862	中航高科	31,961,374.10	2.44
26	688037	芯源微	31,858,665.00	2.43
27	300568	星源材质	31,808,343.99	2.43
28	002541	鸿路钢构	31,746,974.59	2.43
29	600989	宝丰能源	31,225,593.55	2.39
30	688018	乐鑫科技	30,922,544.22	2.36
31	300114	中航电测	30,761,314.14	2.35
32	601898	中煤能源	30,324,284.58	2.32
33	601966	玲珑轮胎	29,489,424.71	2.25
34	688408	中信博	29,457,872.99	2.25
35	300760	迈瑞医疗	29,331,320.37	2.24

36	688608	恒玄科技	28,730,956.39	2.20
37	600346	恒力石化	28,347,019.32	2.17
38	600426	华鲁恒升	27,925,388.37	2.13
39	603738	泰晶科技	27,866,177.00	2.13
40	600315	上海家化	27,754,696.24	2.12
41	600188	兖矿能源	26,653,618.10	2.04

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。

#### 8.4.3 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	4,349,975,505.07
卖出股票收入（成交）总额	2,956,348,941.84

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	46,994,900.00	1.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	155,166,500.00	4.11
	其中：政策性金融债	155,166,500.00	4.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	49,970,000.00	1.32
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	3,549,000.00	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	255,680,400.00	6.77

#### 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	190306	19进出06	500,000	50,210,000.00	1.33
2	210206	21国开06	500,000	50,035,000.00	1.33
3	012105353	21深圳地铁SCP008	500,000	49,970,000.00	1.32
4	210407	21农发07	500,000	49,920,000.00	1.32
5	019649	21国债01	180,000	18,003,600.00	0.48

#### 8.7 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。

#### 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

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、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。

## 8.12.2 本基金前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

## 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	416,618.96
2	应收证券清算款	9,280,987.34
3	应收股利	-
4	应收利息	3,166,100.12
5	应收申购款	1,998,417.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,862,123.86

## 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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## 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		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
48,45	31,034.85	1,282,789,86	85.30%	221,128,076.1	14.70%

9		0.99		9	
---	--	------	--	---	--

## 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	8,153,648.17	0.54%

## 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、基金投资和研发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	611,288,839.34
本报告期基金总申购份额	1,649,290,416.77
减：本报告期基金总赎回份额	756,661,318.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,503,917,937.18

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

1、基金管理人以通讯方式召开本基金基金份额持有人大会，大会投票表决时间自2021年6月14日起至2021年7月13日17:00止，审议《关于圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同的议案》，根据计票结果，本次持有人大会未达到《基金合同》约定的召开基金份额持有人大会的有效条件，未产生持有人大会决议。

2、基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定以通讯方式第二次召开基金份额持有人大会，大会投票表决时间自2021年11月15日起至2021年12月14日17:00止。大会审议通过《关于圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同的议案》。基金份额持有人大会决议事项实施情况：自2021年12月16日起，已修改并执行：

(1) 修改“优享生活主题相关证券”的定义；

(2) 修改本基金的投资范围、投资组合比例、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征等；

(3) 根据前述变更及相关法律法规修订《基金合同》和其他法律文件。

根据《关于圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同的说明》以及相关法律法规的规定，基金管理人已对本基金基金合同、托管协议、招募说明书、产品资料概要的有关内容进行了修订，修订内容自2021年12月16日起正式生效。

具体信息请参见基金管理人于2021年12月16日在规定媒介披露的《关于圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金第二次基金份额持有人大会决议生效的公告》。

## 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的重大人事变动如下：

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。

## 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

基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过《关于圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同的议案》。

基金份额持有人大会决议事项实施情况：自2021年12月16日起，已修改并执行更新后的投资策略：

(二) 优享生活主题的界定

更新为：

本基金所指的优享生活主题相关证券是指能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，以提升居民生活品质方面需求等上市公司发行的证券。

优享生活主题相关行业的范畴会随着技术的进步不断变化，基金管理人将持续关注相关行业最新技术及商业模式的发展，对优享生活主题相互行业的定义进行动态更新。

(一) 资产配置策略

更新为：

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，评估比较股票市场、债券市场、债券品种及现金类资产的收益风险特征，在基准配置比例的基础上，动态调整各大类资产的投资比例，控制投资组合的系统性风险。

作为经济的晴雨表，股票市场波动的核心在于经济周期的变化，是典型的经济领先指标，因此本基金对于股票等大类资产的配置比例，主要依据对宏观经济、市场流动性、通货膨胀等因素的综合预期。本基金的股票类资产投资比例主要依据预期流动性增速与名义GDP增速的关系，并考虑CPI和企业预期盈利水平来进行调整。

股票类资产占比

预期流动性增速<预期名义GDP增速 0-45%

预期流动性增速>预期名义GDP增速，且CPI非食品项上行引发通胀压力较大  
35%-80%

预期流动性增速>预期名义GDP增速，且预期企业盈利增速上行 50%-95%

如果股票类资产的投资比例不符合上述比例限制，基金管理人应在10个交易日内调整使基金的股票投资比例达到对应的资产配置比例要求。

### （三）股票投资策略

新增：

#### 3、港股通标的股票投资策略

在香港股票投资方面，本基金将通过港股通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。本基金对于港股通标的股票的投资，也将通过上述个股及行业优选策略相结合的方法，积极优选相对于A股具有明显估值优势且质地优良的港股通标的股票。

### （四）债券投资策略

删除：6、中小企业私募债券投资策略

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

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

删除：

### （七）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。在进行权证投资时，基金管理人将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，根据权证的高杠杆性、

有限损失性、灵活性等特性，通过限量投资、趋势投资、优化组合、获利等投资策略进行权证投资。基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

新增：（七）国债期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

### 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10万元。该审计机构已提供审计服务的持续年限为5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、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 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		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	2	520,693,740.23	7.15%	484,929.74	7.64%	-

证券						
东方证券	2	298,008,590.05	4.09%	217,933.84	3.44%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	504,545,627.08	6.92%	318,518.97	5.02%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	913,195,842.52	12.53%	850,460.05	13.41%	-
国信证券	2	496,909,860.70	6.82%	363,387.50	5.73%	-
海通证券	2	1,031,512,386.84	14.16%	960,646.31	15.14%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	346,639,226.11	4.76%	322,824.77	5.09%	-
天风证券	2	255,233,211.24	3.50%	186,653.29	2.94%	-
西南证券	2	256,313,873.40	3.52%	161,806.95	2.55%	-
招商证券	2	205,749,626.29	2.82%	191,615.32	3.02%	-
中金公司	2	353,266,548.26	4.85%	328,996.25	5.19%	-
中信建投	2	1,141,056,180.81	15.66%	1,062,662.53	16.75%	-
中信证券	2	500,699,339.21	6.87%	466,302.21	7.35%	-
兴业	2	462,481,410.20	6.35%	427,073.78	6.73%	-

证券						
----	--	--	--	--	--	--

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
- (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

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		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	9,109,895.70	6.63%	3,756,600,000.00	5.91%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-



光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	57,005,100.00	41.50%	9,379,000,000.00	14.76%	-	-	-	-
国信证券	-	-	5,739,000,000.00	9.03%	-	-	-	-
海通证券	21,735,460.70	15.82%	9,356,000,000.00	14.72%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	4,998,000.00	3.64%	3,287,000,000.00	5.17%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	2,498,000,000.00	3.93%	-	-	-	-
招商证券	-	-	752,000,000.00	1.18%	-	-	-	-
中金公司	4,545,258.50	3.31%	2,398,600,000.00	3.77%	-	-	-	-
中信建投	16,027,327.07	11.67%	12,994,000,000.00	20.45%	-	-	-	-
中信证券	12,243,247.30	8.91%	5,739,000,000.00	9.03%	-	-	-	-
兴业证券	11,689,636.80	8.51%	7,645,000,000.00	12.03%	-	-	-	-

### 11.8 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	关于圆信永丰基金管理有限公司旗下部分基金参加中国银河证券股份有限公司公募基金申购、定投费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-01-13
2	圆信永丰优享生活灵活配置	证监会规定媒介	2021-01-22

	混合型证券投资基金2020年第四季度报告		
3	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
4	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	证监会规定媒介	2021-03-10
5	圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告	证监会规定媒介	2021-03-31
6	圆信永丰优享生活灵活配置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
7	圆信永丰基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额的数额限制的公告	证监会规定媒介	2021-04-27
8	圆信永丰基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额的数额限制的公告	证监会规定媒介	2021-05-08
9	圆信永丰基金管理有限公司关于以通讯方式召开圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证监会规定媒介	2021-06-07
10	圆信永丰基金管理有限公司关于以通讯方式召开圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证监会规定媒介	2021-06-08

11	圆信永丰基金管理有限公司关于以通讯方式召开圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证监会规定媒介	2021-06-09
12	圆信永丰优享生活灵活配置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
13	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-06-30
14	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加上海基煜基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-07-08
15	关于圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	证监会规定媒介	2021-07-15
16	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下基金开通电子直销的兴业银行“汇收付”支付渠道并开放定投、转换的公告	证监会规定媒介	2021-07-15
17	圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金2021年第二季度报告	证监会规定媒介	2021-07-21
18	关于圆信永丰基金管理有限公司旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司开展的申购、定投费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-08-13

19	圆信永丰基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额的数额限制的公告	证监会规定媒介	2021-08-21
20	关于圆信永丰基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司申购业务费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-08-27
21	圆信永丰基金管理有限公司关于增加兴业银行股份有限公司（钱大掌柜）为旗下部分基金的销售机构并开通申购、赎回、定投业务以及参加费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-08-27
22	圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金2021年中期报告	证监会规定媒介	2021-08-31
23	圆信永丰基金管理有限公司关于电子直销交易暂停受理工商银行直连支付渠道开户业务的公告	证监会规定媒介	2021-09-04
24	关于圆信永丰基金管理有限公司旗下部分基金参加江苏银行股份有限公司公募基金申购、定投费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-09-17
25	圆信永丰基金管理有限公司圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2021-09-30
26	关于圆信永丰基金管理有限公司旗下基金参加海银基金	证监会规定媒介	2021-10-20

	销售有限公司基金认购、申购、定投费率优惠活动的公告		
27	圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金2021年第三季度报告	证监会规定媒介	2021-10-27
28	圆信永丰基金管理有限公司关于以通讯方式第二次召开圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证监会规定媒介	2021-11-10
29	圆信永丰基金管理有限公司关于以通讯方式第二次召开圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证监会规定媒介	2021-11-11
30	圆信永丰基金管理有限公司关于以通讯方式第二次召开圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证监会规定媒介	2021-11-12
31	关于圆信永丰基金管理有限公司旗下基金参加华安证券股份有限公司基金申购、定投费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-11-22
32	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	证监会规定媒介	2021-11-26
33	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下基金开通电子直销的交通银行直连支付渠道并	证监会规定媒介	2021-11-29

	开放定投、转换的公告		
34	圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金托管协议更新	证监会规定媒介	2021-12-16
35	关于圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金第二次基金份额持有人大会决议生效的公告	证监会规定媒介	2021-12-16
36	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更新	证监会规定媒介	2021-12-16
37	圆信永丰优享生活灵活配置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	2021-12-16
38	圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2021-12-16
39	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司电子银行申购费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-12-29
40	圆信永丰基金管理有限公司关于旗下基金参与中国工商银行股份有限公司“2022倾心回馈”基金定期定额投资业务费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-12-29

## § 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

投资者	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

类别		20%的时间区间					
机构	1	20210101-20210111	133,879,380.57	89,139,992.10	73,827,242.52	149,192,130.15	9.92%
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。							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准圆信永丰优享生活灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
2. 《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》；
3. 《圆信永丰优享生活灵活配置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。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 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

二〇二二年三月三十一日