圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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:2026 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、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月28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、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2026年1月1日起至2026年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 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遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 45
7.1 期末基金资产组合情况 45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
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 46
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 54
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 54
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 54
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 54
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 55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 55
7.12 投资组合报告附注 55
§8 基金份额持有人信息 56

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 56
8.2 盈利投资者数量占比 56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 56
8.4 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 57
§9 开放式基金份额变动 57
§10 重大事件揭示 57
10.1 基金份额持有人大会决议 57
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 57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 57
10.4 基金投资策略的改变 57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 58
10.8 其他重大事件 61
§11 影响投资者决策的其他重要信息 62
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 62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 62
§12 备查文件目录 62
12.1 备查文件目录 62
12.2 存放地点 62
12.3 查阅方式 62

§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	125,987,928.42份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于优悦生活主题产业和行业中的标的，在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，为基金持有人创造良好的投资回报。
投资策略	本基金通过对国家宏观经济政策的深入分析，在动态跟踪财政政策、货币政策的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响和预期收益风险，评估股票、债券等大类资产的估值水平和投资价值，确定投资组合的资产配置比例，并适时进行调整。本基金定义的优悦生活主题，重点关注能够为居民生活消费提供优质的服务，能够使居民在生活健康以及物质精神生活质量等方面感受到愉悦和满足等等。本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%＋上证国债指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		圆信永丰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王几高	郭明
	联系电话	021-68033400	010-66105799
	电子邮箱	service@gtsfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006070088	95588
传真		021-68033401	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55号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦22层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		胡荣炜	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.gtsfund.com.cn
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦22层

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	上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦22层

§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 （2026年01月01日- 2026年06月30日）
本期已实现收益	65,153,368.05
本期利润	64,617,611.83
加权平均基金份额本期利润	0.4902
本期加权平均净值利润率	19.06%
本期基金份额净值增长率	21.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 （2026年06月30日）
期末可供分配利润	210,873,965.90
期末可供分配基金份额利润	1.6738
期末基金资产净值	359,661,170.52
期末基金份额净值	2.8547
3.1.3 累计期末指标	报告期末 （2026年06月30日）
基金份额累计净值增长率	246.92%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	19.10%	1.42%	8.07%	0.82%	11.03%	0.60%

过去六个月	21.50%	1.59%	5.62%	0.74%	15.88%	0.85%
过去一年	62.82%	1.52%	17.34%	0.66%	45.48%	0.86%
过去三年	63.83%	1.41%	24.68%	0.72%	39.15%	0.69%
过去五年	65.28%	1.27%	5.82%	0.72%	59.46%	0.55%
过去七年	265.72%	1.27%	34.26%	0.75%	231.46%	0.52%
自基金合同生效起至今	246.92%	1.25%	27.13%	0.79%	219.79%	0.46%

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2026年6月30日，公司旗下共管理37只开放式基金产品，包括4只股票型基金、20只混合型基金、12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		
田玉铎	本基金基金经理	2026-04-22	-	10年	清华大学会计学硕士。现任圆信永丰基金管理有限公司权益投资部基金经理。历任五矿证券固定收益事业部研究员，合众资产管理组合管理部研究员，国泰君安证券研究所资深分析师，圆信永丰基金管理有限公司专户二部投资经理助理、投资经理。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格证。
党伟	本基金基金经理	2024-04-03	2026-04-22	10年	上海复旦大学金融硕士，历任圆信永丰基金管理有限公司研究部助理研究员、研究员、权益投资部基金经理。国籍：中国，获得的相关业务资格：基金从业资格证。

注1：证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

注2：田玉铎、党伟的“任职日期”为公告确定的任职日期。

注3：党伟的“离任日期”为公告确定的离任日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在风险可控的前提下为基金份额持有人谋求最大利益。基金管理人遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、该基金基金合同的规定。基金经理对个券和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和《圆信永丰基金管理有限公司公平交易管理办法》的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保基金管理人管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

基金管理人各类基金资产、私募资产管理计划资产独立运作。对于交易所市场投资，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照价格优先、时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资，基金管理人通过交易对手控制和询价机制，严格防范对手风险并抽检价格公允性；对于申购投资行为，基金管理人遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过每季度和每年度对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，基金管理人未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，基金管理人未发现存在有可能导致不公平交易和利益输送等的异常交易行为。

基金管理人旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金重点从科技、周期、高盈利质量等维度精选标的，动态调整组合的风险敞口与收益特征，力求获取超额收益。

2026年上半年，市场内部分化显著，科技股一枝独秀。这是资本市场对AI时代的映射。面对AI浪潮，一方面在投资研究中加大AI工具的使用，提升研究的广度、深度，提

升研究的效率。另一方面，则加强相关技术和公司持续跟踪和研究，发掘行业壁垒高、具有竞争优势、成长空间大的优秀个股进行配置。

同时，从组合管理的视角，面对市场的一致预期和交易拥挤，也需要警惕市场的波动，做好进攻与防守的平衡，并切实通过组合调整来进行应对，力争为持有人带来较好的持有体验。

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2.8547元，本报告期内，基金份额净值增长率为21.50%，同期业绩比较基准收益率为5.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济结构不断转型升级，以Deepseek为代表的国产大模型不断突破，并伴随国产算力产业链的不断完善，AI产业链在我国经济中的直接和间接影响不断扩大，成为我国经济发展的重要动能。在我国政策的长期支持和引导下，我国的新能源产业链已经具有全球领先的竞争力，为AI算力的电力供应提供了良好保障。后续，随着国产芯片的升级和突破，我国将构建完善的AI算力产业链体系，从而让我国在AI时代构建出全球领先的竞争力。

发达经济体方面，分化和不确定性仍然凸出。中东地区为代表的全球地缘格局的走势、美国中期选举以及美联储的货币政策都构成了重大不确定性。考虑美国财政可持续性的要求、选民的诉求，预期下半年海外的风险相对可控，流动性总体保持宽松状态。

当前，全球科技股联动性加强，市场存在一定的交易拥挤。AI时代的广阔天地和公司的短期业绩之间构成一定的错位，给市场带来波动。上半年国内市场的宽基ETF显著流出，市场长期资金得到积蓄，构成了后续市场的重要增量资金来源。然而，科技进展或仍然是决定市场方向的力量。AI的商业化闭环的实现、国产算力产业链的完善是下半年需要重点关注的方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并设立估值委员会具体负责监督执行。估值委员会的成员由首席投资官或其授权代表、清算登记部分管领导、研究部负责人、监察稽核部总监、风险管理部总监、清算登记部总监和经办基金会计组成。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人--圆信永丰基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对圆信永丰基金管理有限公司编制和披露的本基金2026年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	22,098,582.83	41,628.14
结算备付金		6,769,733.91	2,517,919.21
存出保证金		5,892,084.26	113,152.36
交易性金融资产	6.4.7.2	325,846,095.92	279,448,101.37
其中：股票投资		287,380,006.76	244,141,670.19
基金投资		-	-
债券投资		38,466,089.16	35,306,431.18
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	27,953,265.54
应收清算款		18,638,693.57	1,184,346.94
应收股利		-	-
应收申购款		32,093.22	181,306.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		379,277,283.71	311,439,720.46
负债和净资产	**附注号**	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		18,012,174.83	730,191.26
应付赎回款		550,205.79	121,701.10
应付管理人报酬		330,094.39	331,336.32
应付托管费		55,015.72	55,222.70
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		16,763.51	188.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	651,858.95	343,152.47
负债合计		19,616,113.19	1,581,792.72
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	125,987,928.42	131,881,250.77
未分配利润	6.4.7.8	233,673,242.10	177,976,676.97
净资产合计		359,661,170.52	309,857,927.74
负债和净资产总计		379,277,283.71	311,439,720.46

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额净值2.8547元，基金份额总额125,987,928.42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：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		67,062,900.04	6,497,557.68
1.利息收入		158,784.83	36,388.83
其中：存款利息收入	6.4.7.9	42,365.19	25,379.96
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		116,419.64	11,008.87
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		67,407,194.55	9,543,996.14
其中：股票投资收益	6.4.7.10	61,075,998.90	5,034,218.67
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	3,601,115.17	2,253,846.43
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	490,894.57	-
股利收益	6.4.7.16	2,239,185.91	2,255,931.04
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-535,756.22	-3,169,771.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	32,676.88	86,944.09
减：二、营业总支出		2,445,288.21	2,157,468.77
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,017,515.12	1,767,110.49
2.托管费	6.4.10.2.2	336,252.53	294,518.41
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		35.51	-
其中：卖出回购金融资产支出		35.51	-
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-

7.税金及附加		1,915.57	354.63
8.其他费用	6.4.7.20	89,569.48	95,485.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		64,617,611.83	4,340,088.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		64,617,611.83	4,340,088.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		64,617,611.83	4,340,088.91

6.3 净资产变动表

会计主体：圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	131,881,250.77	177,976,676.97	309,857,927.74
二、本期期初净资产	131,881,250.77	177,976,676.97	309,857,927.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,893,322.35	55,696,565.13	49,803,242.78
（一）、综合收益总额	-	64,617,611.83	64,617,611.83
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-5,893,322.35	-8,921,046.70	-14,814,369.05

其中：1.基金申购款	22,951,600.37	35,731,235.89	58,682,836.26
2.基金赎回款	-28,844,922.72	-44,652,282.59	-73,497,205.31
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	125,987,928.42	233,673,242.10	359,661,170.52
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	160,067,816.00	147,783,058.75	307,850,874.75
二、本期期初净资产	160,067,816.00	147,783,058.75	307,850,874.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,639,093.17	10,441,576.05	18,080,669.22
（一）、综合收益总额	-	4,340,088.91	4,340,088.91
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	7,639,093.17	6,101,487.14	13,740,580.31
其中：1.基金申购款	45,586,330.68	42,319,214.41	87,905,545.09
2.基金赎回款	-37,947,237.51	-36,217,727.27	-74,164,964.78
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产	-	-	-

变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	167,706,909.17	158,224,634.80	325,931,543.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

高健	姚德明	刘雪峰
_____	_____	_____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×65%＋上证国债指数收益率×35%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号--定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号<会计报表附注的编制及披露>》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026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2026年6月30日的财务状况以及2026年中期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、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[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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交易，资管产品管理人为纳税人。自2026年1月1日至2027年12月31日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自2026年1月1日至2027年12月31日，金融同业往来利息收入免征增值税；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末

	2026年06月30日
活期存款	22,098,582.83
等于：本金	22,096,303.92
加：应计利息	2,278.91
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	22,098,582.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		260,340,759.00	-	287,380,006.76	27,039,247.76
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	18,193,865.50	221,211.35	18,399,771.35	-15,305.50
	银行间市场	20,029,320.00	28,317.81	20,066,317.81	8,680.00
	合计	38,223,185.50	249,529.16	38,466,089.16	-6,625.50
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	298,563,944.50	249,529.16	325,846,095.92	27,032,622.26

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-33,921,780.00	-	-	-
--股指期货	-33,921,780.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-33,921,780.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IH2609	上证50股指期货2609合约	11.00	9,671,640.00	29,400.00
IC2609	中证500股指期货2609合约	-8.00	-14,018,240.00	-683,274.28
IM2609	中证1000股指期货2609合约	-20.00	-33,940,000.00	-1,222,855.87
IF2609	沪深300股指期货2609合约	3.00	4,364,820.00	40,830.00
合计				-1,835,900.15
减：可抵销期货暂收款				-1,835,900.15

净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	684.34
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	568,918.82
其中：交易所市场	568,588.82
银行间市场	330.00
应付利息	-
预提费用	82,255.79
合计	651,858.95

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	131,881,250.77	131,881,250.77
本期申购	22,951,600.37	22,951,600.37
本期赎回（以“-”号填列）	-28,844,922.72	-28,844,922.72
本期末	125,987,928.42	125,987,928.42

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	154,201,863.71	23,774,813.26	177,976,676.97
本期期初	154,201,863.71	23,774,813.26	177,976,676.97
本期利润	65,153,368.05	-535,756.22	64,617,611.83
本期基金份额交易产生的变动数	-8,481,265.86	-439,780.84	-8,921,046.70
其中：基金申购款	31,382,952.95	4,348,282.94	35,731,235.89
基金赎回款	-39,864,218.81	-4,788,063.78	-44,652,282.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	210,873,965.90	22,799,276.20	233,673,242.10

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	28,540.98
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	13,603.05
其他	221.16
合计	42,365.19

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	766,467,387.21
减：卖出股票成本总额	704,237,693.66
减：交易费用	1,153,694.65
买卖股票差价收入	61,075,998.90

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	188,770.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,412,344.85
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	3,601,115.17

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	61,933,599.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑	58,293,465.98

付）成本总额	
减：应计利息总额	224,181.64
减：交易费用	3,607.46
买卖债券差价收入	3,412,344.85

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
期货投资	490,894.57

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,239,185.91
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,239,185.91

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期

	2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	1,300,143.93
——股票投资	1,528,219.98
——债券投资	-228,076.05
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-1,835,900.15
——权证投资	-
——期货投资	-1,835,900.15
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	-535,756.22

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	32,676.84
转换费收入	0.04
合计	32,676.88

注1：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的50%归入基金资产。

注2：本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的50%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	18,248.42
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,813.69
账户维护费	9,000.00
合计	89,569.48

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、关联关系

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 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,017,515.12	1,767,110.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	734,338.15	750,770.08
应支付基金管理人的净管理费	1,283,176.97	1,016,340.41

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1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	336,252.53	294,518.41

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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025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	22,098,582.83	28,540.98	965,974.65	24,146.40

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301666	大普微	2026-04-08	6个月以上	创业板打新限售	46.08	571.99	523	24,099.84	299,150.77	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6个月以上	科创板打新限售	22.68	46.82	3,304	74,934.72	154,693.28	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月以上	深交所打新限售	10.11	10.11	11,225	113,484.75	113,484.75	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月以上	科创板打新限售	44.56	642.06	134	5,971.04	86,036.04	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月以上	科创板打新限售	19.68	170.81	485	9,544.80	82,842.85	-

688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月以上	科创板打新限售	9.47	70.09	963	9,119.61	67,496.67	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月以上	深交所打新限售	10.12	35.24	1,804	18,256.48	63,572.96	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月以上	创业板打新限售	69.66	159.94	332	23,127.12	53,100.08	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月以上	科创板打新限售	40.98	405.52	128	5,245.44	51,906.56	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	4,810	48,629.10	48,629.10	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月以上	科创板打新限售	17.52	35.90	1,350	23,652.00	48,465.00	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月以上	科创板打新限售	26.28	182.77	234	6,149.52	42,768.18	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月以上	科创板打新限售	92.18	462.56	83	7,650.94	38,392.48	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月以上	深交所打	7.82	25.28	1,485	11,612.70	37,540.80	-

				新限售						
688811	有研复材	2026-04-01	6个月以上	科创板打新限售	6.41	27.75	834	5,345.94	23,143.50	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月以上	上交所打新限售	17.70	99.76	229	4,053.30	22,845.04	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月以上	创业板打新限售	24.68	104.80	216	5,330.88	22,636.80	-
301669	高特电子	2026-06-02	6个月以上	创业板打新限售	7.08	37.52	546	3,865.68	20,485.92	-
301531	春光集团	2026-04-28	6个月以上	创业板打新限售	13.30	66.90	290	3,857.00	19,401.00	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月以上	创业板打新限售	13.91	40.66	425	5,911.75	17,280.50	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月以上	深交所打新限售	27.19	36.79	363	9,869.97	13,354.77	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月以上	创业板打新限售	58.00	112.13	113	6,554.00	12,670.69	-

001393	维通利	2026-05-08	6个月以上	深交所打新限售	30.38	48.48	253	7,686.14	12,265.44	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月以上	创业板打新限售	78.38	129.27	80	6,270.40	10,341.60	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月以上	深交所打新限售	53.26	65.85	145	7,722.70	9,548.25	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月以上	创业板打新限售	26.66	63.44	138	3,679.08	8,754.72	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月以上	上交所打新限售	15.76	60.62	104	1,639.04	6,304.48	-
920136	永励精密	2026-06-25	1个月内（含）	新股未上市	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月以上	上交所打新限售	11.18	17.57	303	3,387.54	5,323.71	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月以上	上交所打新限售	21.88	25.50	107	2,341.16	2,728.50	-
920193	吉和昌	2026-06-18	1个月内（含）	新股未上	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-

				市						
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月以上	上交所打新限售	33.49	38.45	61	2,042.89	2,345.45	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月以上	深交所打新限售	18.38	18.20	122	2,242.36	2,220.40	-
920189	康美特	2026-06-30	1个月内（含）	新股未上市	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月以上	上交所打新限售	37.88	34.86	46	1,742.48	1,603.56	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月以上	创业板打新限售	21.93	76.74	195	4,276.35	14,964.30	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
113703	翔26转债	2026-06-09	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	3,750	375,000.00	375,037.81	-

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一部门及岗位负有监督责任；以公司督察长、监察稽核部门对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道防线，督察长、监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈；以董事会下属风险与合规管理委员会对公司经营管理和基金运作中的合法合规性实行全面监督的第四道防线。风险与合规管理委员会对公司经营和基金运作中的风险进行严格的合规检查和风险控制评估并审议公司风险管理工作报告。董事会对基金管理人的风险管理负有最终责任。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	18,024,733.54	18,108,542.47
合计	18,024,733.54	18,108,542.47

注：未评级债券为国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-

AAA以下	375,037.81	17,197,888.71
未评级	20,066,317.81	-
合计	20,441,355.62	17,197,888.71

注：未评级债券为政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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%。于本期末，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未超过15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2026年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	22,098,582.83	-	-	-	22,098,582.83
结算备付金	6,769,733.91	-	-	-	6,769,733.91
存出保证金	5,892,084.26	-	-	-	5,892,084.26
交易性金融资产	38,091,051.35	-	375,037.81	287,380,006.76	325,846,095.92
应收清算款	-	-	-	18,638,693.57	18,638,693.57
应收申购款	-	-	-	32,093.22	32,093.22
资产总计	72,851,452.35	-	375,037.81	306,050,793.55	379,277,283.71
负债					
应付清算款	-	-	-	18,012,174.83	18,012,174.83
应付赎回款	-	-	-	550,205.79	550,205.79
应付管理人报酬	-	-	-	330,094.39	330,094.39
应付托管费	-	-	-	55,015.72	55,015.72
应交税费	-	-	-	16,763.51	16,763.51
其他负债	-	-	-	651,858.95	651,858.95
负债总计	-	-	-	19,616,113.19	19,616,113.19

利率敏感度缺口	72,851,452.35	-	375,037.81	286,434,680.36	359,661,170.52
上年度末2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	41,628.14	-	-	-	41,628.14
结算备付金	2,517,919.21	-	-	-	2,517,919.21
存出保证金	113,152.36	-	-	-	113,152.36
交易性金融资产	18,108,542.47	17,197,888.71	-	244,141,670.19	279,448,101.37
买入返售金融资产	27,953,265.54	-	-	-	27,953,265.54
应收清算款	-	-	-	1,184,346.94	1,184,346.94
应收申购款	-	-	-	181,306.90	181,306.90
资产总计	48,734,507.72	17,197,888.71	-	245,507,324.03	311,439,720.46
负债					
应付清算款	-	-	-	730,191.26	730,191.26
应付赎回款	-	-	-	121,701.10	121,701.10
应付管理人报酬	-	-	-	331,336.32	331,336.32
应付托管费	-	-	-	55,222.70	55,222.70

应交税费	-	-	-	188.87	188.87
其他负债	-	-	-	343,152.47	343,152.47
负债总计	-	-	-	1,581,792.72	1,581,792.72
利率敏感度缺口	48,734,507.72	17,197,888.71	-	243,925,531.31	309,857,927.74

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2026年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为10.70%(2025年12月31日：11.39%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资比例为基金资产的40%-80%；投资于优悦生活主题相关的证券比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申

购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025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	287,380,006.76	79.90	244,141,670.19	78.79
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	287,380,006.76	79.90	244,141,670.19	78.79

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	1.沪深300指数上升5%	21,036,264.17	19,788,390.25

	2.沪深300指数下降5%	-21,036,264.17	-19,788,390.25

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	285,953,740.61	260,567,647.60
第二层次	38,524,686.26	18,108,542.47
第三层次	1,367,669.05	771,911.30
合计	325,846,095.92	279,448,101.37

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	287,380,006.76	75.77
	其中：股票	287,380,006.76	75.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,466,089.16	10.14
	其中：债券	38,466,089.16	10.14
	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	-	-
	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	28,868,316.74	7.61
8	其他各项资产	24,562,871.05	6.48
9	合计	379,277,283.71	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	1,347,261.00	0.37

B	采矿业	2,760,202.80	0.77
C	制造业	245,403,251.30	68.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,714,161.05	1.59
E	建筑业	10,472,770.00	2.91
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,522,211.00	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,719,473.71	2.98
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,856,427.90	1.35
N	水利、环境和公共设施管理业	1,584,248.00	0.44
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	287,380,006.76	79.90

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	000725	京东方A	1,434,900	12,454,932.00	3.46
2	002475	立讯精密	158,000	11,123,200.00	3.09
3	002138	顺络电子	148,300	10,840,730.00	3.01

4	603929	亚翔集成	38,500	10,472,770.00	2.91
5	600160	巨化股份	187,000	9,912,870.00	2.76
6	600183	生益科技	56,800	9,849,120.00	2.74
7	688630	芯碁微装	16,143	8,868,802.77	2.47
8	688002	睿创微纳	55,554	8,593,648.26	2.39
9	002371	北方华创	9,500	8,403,320.00	2.34
10	600176	中国巨石	102,500	7,470,200.00	2.08
11	300604	长川科技	21,500	7,340,530.00	2.04
12	000977	浪潮信息	87,700	6,139,000.00	1.71
13	000333	美的集团	77,200	5,830,916.00	1.62
14	601016	节能风电	1,430,940	5,552,047.20	1.54
15	600584	长电科技	51,400	5,322,470.00	1.48
16	300776	帝尔激光	23,700	5,094,552.00	1.42
17	688981	中芯国际	31,814	5,052,699.48	1.40
18	688256	寒武纪	2,871	4,580,824.05	1.27
19	920599	同力股份	274,696	4,524,243.12	1.26
20	603124	江南新材	22,600	4,225,748.00	1.17
21	002993	奥海科技	57,267	4,100,889.87	1.14
22	688323	瑞华泰	71,649	4,048,168.50	1.13
23	603799	华友钴业	83,100	4,010,406.00	1.12
24	300806	斯迪克	35,500	3,976,000.00	1.11
25	002436	兴森科技	72,400	3,688,780.00	1.03
26	600150	中国船舶	109,000	3,683,110.00	1.02
27	300037	新宙邦	39,000	3,621,150.00	1.01
28	002001	新和成	124,500	3,538,290.00	0.98
29	300394	天孚通信	11,480	3,474,766.40	0.97
30	688372	伟测科技	18,438	3,429,468.00	0.95
31	301603	乔锋智能	23,600	3,393,680.00	0.94
32	301571	国科天成	51,400	3,350,252.00	0.93
33	688041	海光信息	9,038	3,346,771.40	0.93
34	688300	联瑞新材	12,949	3,164,735.60	0.88

35	688521	芯原股份	8,015	2,974,687.10	0.83
36	603938	三孚股份	40,200	2,880,330.00	0.80
37	300567	精测电子	9,000	2,858,400.00	0.79
38	688025	杰普特	5,929	2,786,630.00	0.77
39	601899	紫金矿业	108,300	2,722,662.00	0.76
40	688387	信科移动	136,999	2,718,060.16	0.76
41	601872	招商轮船	152,900	2,686,453.00	0.75
42	600346	恒力石化	150,800	2,670,668.00	0.74
43	688702	盛科通信	6,816	2,658,171.84	0.74
44	688268	华特气体	9,868	2,639,690.00	0.73
45	300450	先导智能	62,700	2,553,144.00	0.71
46	603986	兆易创新	3,100	2,526,500.00	0.70
47	688123	聚辰股份	11,781	2,504,640.60	0.70
48	688535	华海诚科	13,019	2,434,553.00	0.68
49	603379	三美股份	31,600	2,398,124.00	0.67
50	688012	中微公司	5,112	2,394,972.00	0.67
51	300408	三环集团	14,300	2,386,670.00	0.66
52	688636	智明达	65,297	2,365,710.31	0.66
53	600497	驰宏锌锗	195,100	2,362,661.00	0.66
54	300497	富祥股份	106,400	2,357,824.00	0.66
55	603876	鼎胜新材	90,300	2,348,703.00	0.65
56	301525	儒竞科技	47,920	2,262,303.20	0.63
57	002046	国机精工	30,700	2,261,055.00	0.63
58	600500	中化国际	269,400	2,109,402.00	0.59
59	600879	航天电子	90,000	1,916,100.00	0.53
60	603871	嘉友国际	179,800	1,835,758.00	0.51
61	002536	飞龙股份	37,300	1,759,814.00	0.49
62	603733	仙鹤股份	63,400	1,712,434.00	0.48
63	002266	浙富控股	312,300	1,580,238.00	0.44
64	002749	国光股份	185,680	1,481,726.40	0.41
65	688120	华海清科	4,310	1,388,595.80	0.39

66	300761	立华股份	82,100	1,347,261.00	0.37
67	688757	胜科纳米	20,087	1,339,802.90	0.37
68	688411	海博思创	4,580	1,333,696.00	0.37
69	600352	浙江龙盛	105,400	1,276,394.00	0.35
70	688820	盛合晶微	4,571	873,933.31	0.24
71	002648	卫星化学	33,700	791,613.00	0.22
72	301217	铜冠铜箔	4,100	676,787.00	0.19
73	688048	长光华芯	1,111	557,722.00	0.16
74	688037	芯源微	1,175	515,883.75	0.14
75	688368	晶丰明源	2,336	505,790.72	0.14
76	300285	国瓷材料	4,700	484,946.00	0.13
77	600141	兴发集团	9,900	465,003.00	0.13
78	688337	普源精电	5,265	394,506.45	0.11
79	301666	大普微	523	299,150.77	0.08
80	301531	春光集团	2,798	207,475.92	0.06
81	001248	华润新能源	16,035	162,113.85	0.05
82	688802	沐曦股份	190	157,377.00	0.04
83	688781	视涯科技	3,304	154,693.28	0.04
84	603259	药明康德	700	87,157.00	0.02
85	688797	臻宝科技	134	86,036.04	0.02
86	688818	电科蓝天	963	67,496.67	0.02
87	001399	惠科股份	1,804	63,572.96	0.02
88	301682	宏明电子	332	53,100.08	0.01
89	688635	长进光子	128	51,906.56	0.01
90	688712	北芯生命	1,350	48,465.00	0.01
91	688813	泰金新能	234	42,768.18	0.01
92	688785	恒运昌	83	38,392.48	0.01
93	001257	盛龙股份	1,485	37,540.80	0.01
94	688811	有研复材	834	23,143.50	0.01
95	001312	福恩股份	1,211	23,074.75	0.01
96	603459	红板科技	229	22,845.04	0.01

97	301696	三瑞智能	216	22,636.80	0.01
98	301669	高特电子	546	20,485.92	0.01
99	301599	理奇智能	425	17,280.50	0.00
100	301687	新广益	195	14,964.30	0.00
101	001365	天海电子	363	13,354.77	0.00
102	301680	固德电材	113	12,670.69	0.00
103	001393	维通利	253	12,265.44	0.00
104	301683	慧谷新材	80	10,341.60	0.00
105	001237	惠康科技	145	9,548.25	0.00
106	301513	尚水智能	138	8,754.72	0.00
107	603435	嘉德利	104	6,304.48	0.00
108	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
109	601112	振石股份	303	5,323.71	0.00
110	603199	九华旅游	100	3,116.00	0.00
111	603352	至信股份	107	2,728.50	0.00
112	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
113	603293	埃泰克	61	2,345.45	0.00
114	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
115	603284	林平发展	46	1,603.56	0.00
116	000888	峨眉山A	100	894.00	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	603799	华友钴业	15,426,316.38	4.98
2	600160	巨化股份	11,601,359.02	3.74
3	002475	立讯精密	11,100,231.00	3.58
4	002001	新和成	10,651,612.00	3.44

5	002138	顺络电子	10,390,936.00	3.35
6	600309	万华化学	10,242,417.00	3.31
7	600346	恒力石化	10,154,152.00	3.28
8	688052	纳芯微	9,683,668.56	3.13
9	000725	京东方A	9,543,280.00	3.08
10	001301	尚太科技	9,483,562.00	3.06
11	000792	盐湖股份	9,436,046.00	3.05
12	600183	生益科技	9,221,384.00	2.98
13	601677	明泰铝业	9,219,623.00	2.98
14	002594	比亚迪	9,109,615.00	2.94
15	002158	汉钟精机	9,103,600.00	2.94
16	601016	节能风电	8,443,006.80	2.72
17	000977	浪潮信息	8,417,633.00	2.72
18	603929	亚翔集成	8,412,584.00	2.71
19	600026	中远海能	8,150,462.00	2.63
20	688002	睿创微纳	8,046,747.76	2.60
21	002466	天齐锂业	7,979,746.00	2.58
22	301603	乔锋智能	7,881,719.00	2.54
23	002246	北化股份	7,767,604.00	2.51
24	000703	恒逸石化	7,497,384.00	2.42
25	688630	芯碁微装	7,381,823.74	2.38
26	688403	汇成股份	7,280,727.71	2.35
27	600415	小商品城	7,233,240.00	2.33
28	300953	震裕科技	7,215,504.00	2.33
29	300015	爱尔眼科	7,175,866.00	2.32
30	000630	铜陵有色	7,134,387.00	2.30
31	002497	雅化集团	7,074,724.00	2.28
32	601009	南京银行	6,970,093.00	2.25
33	002850	科达利	6,573,232.00	2.12
34	600176	中国巨石	6,557,639.00	2.12
35	002078	太阳纸业	6,546,722.00	2.11

36	000688	国城矿业	6,396,226.00	2.06
37	300390	天华新能	6,269,967.90	2.02

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	300593	新雷能	18,213,724.95	5.88
2	300390	天华新能	18,044,835.00	5.82
3	001301	尚太科技	14,876,672.97	4.80
4	002756	永兴材料	14,795,147.00	4.77
5	002240	盛新锂能	14,657,538.00	4.73
6	300395	菲利华	13,872,667.00	4.48
7	600893	航发动力	13,841,558.00	4.47
8	688052	纳芯微	13,008,167.68	4.20
9	300037	新宙邦	12,823,743.00	4.14
10	002460	赣锋锂业	12,745,488.20	4.11
11	688281	华秦科技	12,599,899.59	4.07
12	688401	路维光电	12,192,919.32	3.94
13	300450	先导智能	12,100,116.00	3.91
14	002068	黑猫股份	11,334,885.95	3.66
15	002475	立讯精密	10,661,643.00	3.44
16	000792	盐湖股份	10,121,012.00	3.27
17	688220	翱捷科技	10,120,150.97	3.27
18	600309	万华化学	9,938,947.00	3.21
19	300207	欣旺达	9,832,438.00	3.17
20	688147	微导纳米	9,630,799.00	3.11
21	002158	汉钟精机	9,452,573.00	3.05

22	688778	厦钨新能	9,283,211.81	3.00
23	603659	璞泰来	9,154,189.50	2.95
24	002594	比亚迪	8,963,195.00	2.89
25	000688	国城矿业	8,918,249.00	2.88
26	002203	海亮股份	8,743,230.00	2.82
27	601677	明泰铝业	8,613,455.00	2.78
28	603799	华友钴业	8,571,761.00	2.77
29	001203	大中矿业	8,449,767.00	2.73
30	920522	纳科诺尔	8,320,795.17	2.69
31	002138	顺络电子	8,309,567.00	2.68
32	300035	中科电气	8,005,285.00	2.58
33	300677	英科医疗	7,808,254.60	2.52
34	000630	铜陵有色	7,675,447.75	2.48
35	600026	中远海能	7,596,366.00	2.45
36	000703	恒逸石化	7,427,180.05	2.40
37	600415	小商品城	7,278,798.00	2.35
38	688678	福立旺	7,273,054.70	2.35
39	002497	雅化集团	7,132,663.00	2.30
40	002246	北化股份	7,109,935.00	2.29
41	600346	恒力石化	6,896,540.00	2.23
42	601009	南京银行	6,803,151.00	2.20
43	002466	天齐锂业	6,766,312.00	2.18
44	688403	汇成股份	6,558,880.67	2.12
45	300015	爱尔眼科	6,266,992.00	2.02

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	745,947,810.25
卖出股票收入（成交）总额	766,467,387.21

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	18,024,733.54	5.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,066,317.81	5.58
	其中：政策性金融债	20,066,317.81	5.58
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)	375,037.81	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	38,466,089.16	10.70

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	250202	25国开02	200,000	20,066,317.81	5.58
2	102310	国债2513	100,000	10,126,254.80	2.82
3	019785	25国债13	78,000	7,898,478.74	2.20
4	113703	翔26转债	3,750	375,037.81	0.10

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同约定，本基金不参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

通过查阅中国证监会、国家金融监督管理总局网站公开目录“行政处罚决定”及查阅相关发行主体的公司公告，在基金管理人知悉的范围内，报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，立讯精密工业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局和中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金前十名股票未超出基金合同约定备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,892,084.26
2	应收清算款	18,638,693.57
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	32,093.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,562,871.05

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
6,705	18,790.15	37,992,977.09	30.16%	87,994,951.33	69.84%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	98.45%

8.3 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	38,770.28	0.03%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§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	131,881,250.77
本报告期基金总申购份额	22,951,600.37
减：本报告期基金总赎回份额	28,844,922.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	125,987,928.42

§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且无决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

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

报告期内，本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本基金本报告期内管理人未存在受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本基金本报告期内管理人相关从业人员未存在受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
长江证券	1	216,383,414.04	14.32%	96,487.57	14.35%	-
东方证券	1	241,160,570.33	15.96%	107,533.64	16.00%	-
光大证券	1	128,454,059.63	8.50%	57,280.14	8.52%	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	35,119,758.83	2.32%	15,659.94	2.33%	-
中信建投	1	121,796,795.27	8.06%	54,310.51	8.08%	-

东吴证券	2	72,050,512.20	4.77%	32,125.87	4.78%	-
国金证券	2	4,845,771.00	0.32%	2,160.72	0.32%	-
国投证券	2	53,577,912.86	3.55%	23,891.60	3.55%	-
国信证券	2	180,281,098.46	11.93%	80,389.08	11.96%	-
申万宏源证券	2	162,640,428.09	10.77%	72,522.20	10.79%	-
天风证券	2	20,689,471.41	1.37%	9,225.50	1.37%	-
西南证券	2	56,663,462.96	3.75%	25,266.20	3.76%	-
招商证券	2	74,673,654.26	4.94%	33,296.93	4.95%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	3	142,310,854.58	9.42%	62,081.86	9.24%	-

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）经营行为稳健规范，在业内有良好的声誉；

（3）内控制度健全，内部管理严格，具有良好的合规风控能力，并能满足基金运作高度保密的要求；

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

（5）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员；

（6）具有较强的全方位金融研究、服务能力和水平。

注3：基金选择证券公司交易单元的选择程序如下：

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

（2）本基金管理人与被选中的证券公司签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用或者通过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
长江证券	21,801,273.11	21.05%	661,360,000.00	40.01%	-	-	-	-
东方证券	15,374,263.98	14.85%	259,736,000.00	15.71%	-	-	-	-
光大证券	17,264,526.78	16.67%	139,874,000.00	8.46%	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	16,373,591.15	15.81%	332,364,000.00	20.11%	-	-	-	-
东吴证券	4,381,659.81	4.23%	72,600,000.00	4.39%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	13,237,993.56	12.78%	186,665,000.00	11.29%	-	-	-	-
国信证券	4,233,655.96	4.09%	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1,912,172.13	1.85%	300,000.00	0.02%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	1,358,600.94	1.31%	-	-	-	-	-	-
招商证券	2,470,535.46	2.39%	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	5,150,414.06	4.97%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金2025年第四季度报告	证监会规定媒介	2026-01-22
2	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2026-02-27
3	圆信永丰基金管理有限公司关于变更办公地址等信息的公告	证监会规定媒介	2026-03-06
4	圆信永丰基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	证监会规定媒介	2026-03-06
5	圆信永丰基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告	证监会规定媒介	2026-03-31
6	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金2025年年度报告	证监会规定媒介	2026-03-31
7	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金2026年第一季度报告	证监会规定媒介	2026-04-22
8	圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金经理变更公告	证监会规定媒介	2026-04-23
9	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	2026-04-27
10	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	2026-04-27
11	圆信永丰基金管理有限公司公募基金管理人对外行使投票表决权情况公告	证监会规定媒介	2026-04-30

12	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	2026-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金设立的文件；
2、《圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金基金合同》；
3、《圆信永丰优悦生活混合型证券投资基金托管协议》；
4、报告期内在规定报刊上披露的各项公告；
5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人圆信永丰基金管理有限公司。
咨询电话：4006070088
公司网址：http://www.gtsfund.com.cn

圆信永丰基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日