

# 圆信永丰优选价值混合型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 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:2024 年 03 月 29 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2024年3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2023年01月01日起至2023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	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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
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	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况	61
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	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	67
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	67
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	67
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	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	67

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	68
8.12 投资组合报告附注 .....	68
§9 基金份额持有人信息 .....	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
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 .....	70
§10 开放式基金份额变动 .....	70
§11 重大事件揭示 .....	70
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
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 .....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	71
11.4 基金投资策略的改变 .....	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
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 .....	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
11.8 其他重大事件 .....	74
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
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 .....	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	76
§13 备查文件目录 .....	76
13.1 备查文件目录 .....	76
13.2 存放地点 .....	76
13.3 查阅方式 .....	76

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	圆信永丰优选价值混合型证券投资基金	
基金简称	圆信永丰优选价值	
基金主代码	008311	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年05月18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	126,224,999.97份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	圆信永丰优选价值A	圆信永丰优选价值C
下属分级基金的交易代码	008311	008312
报告期末下属分级基金的份额总额	119,858,153.34份	6,366,846.63份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，本基金充分挖掘各类金融工具的潜在投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
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、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		圆信永丰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	兰文伟	郭明
	联系电话	021-60366000	010-66105799
	电子邮箱	service@gtsfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006070088	95588
传真		021-60366001	010-66105798
注册地址		中国（福建）自由贸易试验区 厦门片区（保税港区）海景南 二路45号4楼402单元之175	北京市西城区复兴门内大街5 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		胡荣炜	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	2023年		2022年		2021年	
	圆信永丰优选价值A	圆信永丰优选价值C	圆信永丰优选价值A	圆信永丰优选价值C	圆信永丰优选价值A	圆信永丰优选价值C
本期已实现收益	-12,660,192.96	-671,130.86	-8,428,918.45	-309,545.14	116,562,784.91	4,914,110.77
本期利润	-31,555,311.29	-1,570,685.37	-78,653,033.95	-2,777,302.93	71,220,203.15	3,304,798.92
加权平均基金份额本期利润	-0.2470	-0.2449	-0.4000	-0.3709	0.2617	0.2763
本期加权平均净值利润率	-20.58%	-21.10%	-29.16%	-27.64%	16.53%	17.68%
本期基金份额净值增长率	-18.62%	-19.27%	-21.32%	-21.95%	15.96%	14.94%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末		2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	9,323,106.83	260,217.54	45,124,171.14	1,957,942.91	150,856,787.83	5,978,121.82
期末可供分配基金份额利润	0.0778	0.0409	0.3244	0.2893	0.6832	0.6518
期末基金资产净值	129,181,260.17	6,627,064.17	184,212,371.60	8,724,789.54	371,672,728.89	15,149,226.75
期末基金份额净值	1.0778	1.0409	1.3244	1.2893	1.6832	1.6518
3.1.3 累计期末指标	2023年末		2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增长率	7.78%	4.09%	32.44%	28.93%	68.32%	65.18%

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

圆信永丰优选价值A

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	-4.08%	0.87%	-4.70%	0.55%	0.62%	0.32%
过去六个月	-8.46%	0.87%	-7.09%	0.59%	-1.37%	0.28%
过去一年	-18.62%	0.89%	-6.90%	0.59%	-11.72%	0.30%
过去三年	-25.75%	1.28%	-22.02%	0.78%	-3.73%	0.50%
自基金合同生效起至今	7.78%	1.26%	-4.29%	0.80%	12.07%	0.46%

圆信永丰优选价值C

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	-4.28%	0.87%	-4.70%	0.55%	0.42%	0.32%
过去六个月	-8.82%	0.87%	-7.09%	0.59%	-1.73%	0.28%
过去一年	-19.27%	0.90%	-6.90%	0.59%	-12.37%	0.31%
过去三年	-27.57%	1.28%	-22.02%	0.78%	-5.55%	0.50%
自基金合同生效起至今	4.09%	1.26%	-4.29%	0.80%	8.38%	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



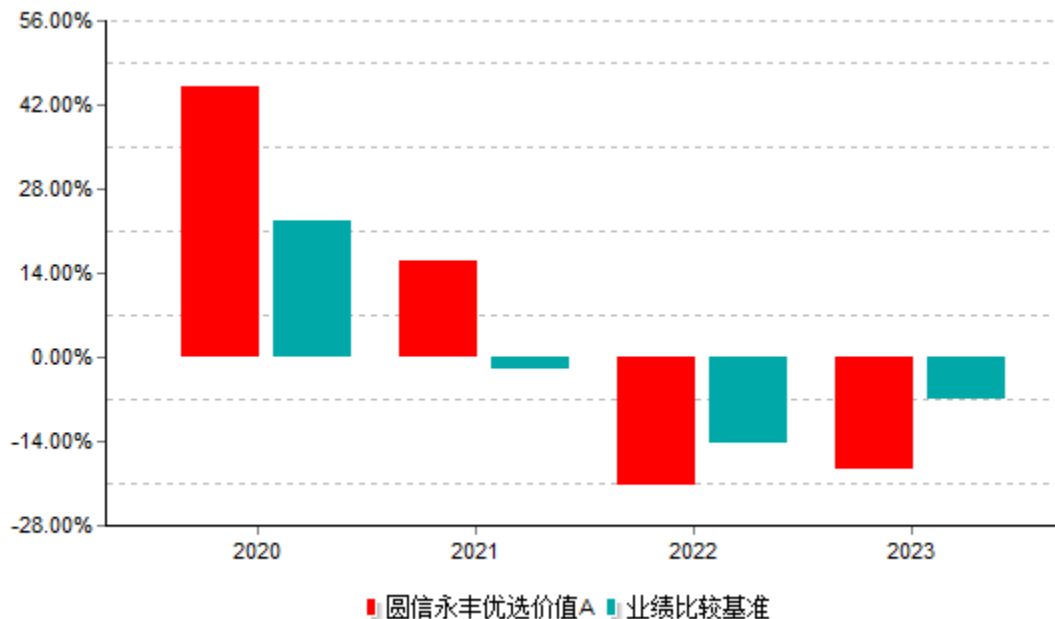
圆信永丰优选价值A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年05月18日-2023年12月31日)



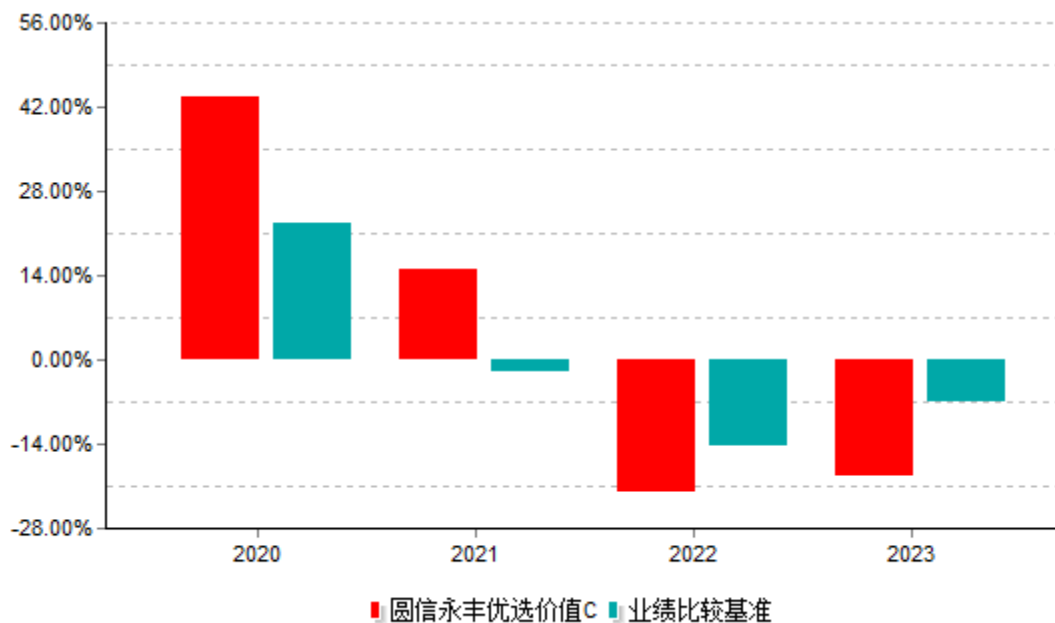
圆信永丰优选价值C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年05月18日-2023年12月31日)



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



注：本基金合同生效日为2020年05月18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。



注：本基金合同生效日为2020年05月18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2023年12月31日，公司旗下共管理31只开放式基金产品，包括4只股票型基金、18只混合型基金、8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		
陈臣	本基金基金经理	2020-05-18	-	13年	上海交通大学工商管理硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司研究部副总监（主持工作）。历任易唯思商务咨询有限公司研究部研究助理，永丰金证券（亚洲）有限公司研究部研究员，中国国际金融股份有限公司研究部研究员，圆信永丰基金管理有限公司研究部研究员、总监助理、权益投资部基金经理兼研究部总监助理。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：陈臣的"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、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 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

2023年，上证综指下跌3.70%，深证成指下跌13.54%，创业板指下跌19.41%，主要指数呈先扬后抑的走势。板块方面，通信、传媒、计算机和电子涨幅较大，美容护理、商贸零售、房地产等跌幅较大，板块走势分化明显。

本基金于全年投资策略保持稳定。报告期内本基金仍坚持高仓运作、长期持有、行业均衡、个股集中的配置策略。行业配置方面，食品饮料、机械、农业、电力设备、军工、建材等相对超配。

##### 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选价值A基金份额净值为1.0778元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-18.62%，同期业绩比较基准收益率为-6.90%；截至报告期末圆信永丰优选价值C基金份额净值为1.0409元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-19.27%，同期业绩比较基准收益率为-6.90%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾2023年，国内经济复苏节奏存在一定波动，但总体稳健，全年GDP增速5.2%，顺利完成年初的增长目标。国内股票市场走势先高后低，随经济增长预期有所波动，结构上来看，TMT行业表现强势，传统经济表现一般，高分红资产受到追捧。

展望2024年，全年GDP增长目标定在5%左右。我们对全年经济总量增长保持乐观态度，我们判断3%的赤字率和万亿特别国债叠加大规模设备更新和“三大工程”政策，投资端有望保持稳健增长；消费端将继续保持韧性，“以旧换新”政策将切实提升行业增长，居民消费倾向有望继续修复；净出口将回归正增长，对经济增长正向拉动。我们认为，今年CPI和PPI有望进入上行通道，企业需求和利润将继续呈现修复态势。中长期维度来看，我们仍然充满信心，即使面临诸多挑战和不确定性，我国经济增长的潜力仍然巨大，对内以“新质生产力”为代表的新生产力有望持续提升全要素生产率，而中国优秀企业的大规模出海之旅方兴未艾。

国内权益市场，年初以来，国内A股遭遇短暂流动性问题，但在主管部门的干预下问题已经大幅缓解，体现了政府对于资本市场的支持与呵护。当前国内A股市场整体估值仍然便宜，考虑到全球可能进入到宽松周期，A股估值具备较大向上修复的潜力，并且随着企业利润进一步修复，我们判断股价向上的动能显著大于向下的动能。

投资端，我们一如既往坚持核心价值观，寻找具有远大前景的优秀企业。未来，具有全球竞争力的先进制造领域、能持续提升社会劳动生产率的创新趋势、经济社会进步带来的高端消费和服务需求，以及符合未来国情和发展特征的行业中有望诞生一批世界级的优秀企业。我们坚持与优秀企业为伍，伴随企业做大做强并分享成长带来的收益，秉持投资初心，追求稳定合理的长期回报，持续为持有人创造价值。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023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。

#### **4.8 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2023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(2024)第24501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	圆信永丰优选价值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选价值混合型证券投资基金(以下简称“圆信永丰优选价值基金”)的财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。(二) 我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业



	协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了圆信永丰优选价值基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于圆信永丰优选价值基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	圆信永丰优选价值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选价值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选价值基金、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选价值基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于



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	2024-03-26

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：圆信永丰优选价值混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	428,027.84	2,627,381.02
结算备付金		28,381.00	369,036.57
存出保证金		11,404.50	19,556.33
交易性金融资产	7.4.7.2	135,645,573.39	191,476,201.91
其中：股票投资		126,341,681.59	181,402,824.43
基金投资		-	-
债券投资		9,303,891.80	10,073,377.48
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	498,904.12
应收清算款		158,176.72	3,938,046.48
应收股利		-	-
应收申购款		3,866.33	11,022.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		136,275,429.78	198,940,148.65

负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<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		-	-
应付清算款		-	5,143,224.58
应付赎回款		88,766.90	103,665.87
应付管理人报酬		134,913.79	270,435.56
应付托管费		22,485.64	45,072.60
应付销售服务费		4,374.82	5,933.99
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4.52	1.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	216,559.77	434,653.30
负债合计		467,105.44	6,002,987.51
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	126,224,999.97	145,855,047.09
未分配利润	7.4.7.8	9,583,324.37	47,082,114.05
净资产合计		135,808,324.34	192,937,161.14
负债和净资产总计		136,275,429.78	198,940,148.65

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额总额126,224,999.97份，其中圆信永丰优选价值混合型证券投资基金A类基金份额净值1.0778元，圆信永丰优选价值混合型证券投资基金A类基金份额119,858,153.34份；圆信永丰优选价值混合型证券投资基金C类基金份额净值1.0409元，圆信永丰优选价值混合型证券投资基金C类基金份额6,366,846.63份。

## 7.2 利润表

会计主体：圆信永丰优选价值混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2 022年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		-30,219,129.36	-76,208,735.09
1.利息收入		11,672.65	20,237.10
其中：存款利息收入	7.4.7.9	10,222.60	16,949.66
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		1,450.05	3,287.44
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		-10,444,169.71	-3,579,665.50
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-12,750,706.93	-6,591,828.26
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	423,220.52	401,481.80
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,883,316.70	2,610,680.96
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.17	-19,794,672.84	-72,691,873.29
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号 填列）	7.4.7.18	8,040.54	42,566.60
<b>减：二、营业总支出</b>		2,906,867.30	5,221,601.79
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	2,267,855.22	4,227,600.76
2.托管费	7.4.10.2.2	377,975.81	704,600.12

3.销售服务费	7.4.10.2.3	59,764.38	80,747.34
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	1,712.87
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,712.87
6.信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7.税金及附加		0.85	0.67
8.其他费用	7.4.7.20	201,271.04	206,940.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-33,125,996.66	-81,430,336.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-33,125,996.66	-81,430,336.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-33,125,996.66	-81,430,336.88

### 7.3 净资产变动表

会计主体：圆信永丰优选价值混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	145,855,047.09	47,082,114.05	192,937,161.14
二、本期期初净资产	145,855,047.09	47,082,114.05	192,937,161.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,630,047.12	-37,498,789.68	-57,128,836.80
（一）、综合收益	-	-33,125,996.66	-33,125,996.66

总额			
(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)	-19,630,047.12	-4,372,793.02	-24,002,840.14
其中: 1.基金申购款	3,607,084.25	808,805.73	4,415,889.98
2.基金赎回款	-23,237,131.37	-5,181,598.75	-28,418,730.12
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	126,224,999.97	9,583,324.37	135,808,324.34
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	229,987,045.99	156,834,909.65	386,821,955.64
二、本期期初净资产	229,987,045.99	156,834,909.65	386,821,955.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-84,131,998.90	-109,752,795.60	-193,884,794.50
(一)、综合收益总额	-	-81,430,336.88	-81,430,336.88
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产	-84,131,998.90	-28,322,458.72	-112,454,457.62

产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	53,556,492.94	20,361,301.81	73,917,794.75
2.基金赎回款	-137,688,491.84	-48,683,760.53	-186,372,252.37
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	145,855,047.09	47,082,114.05	192,937,161.14

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

圆信永丰优选价值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[2019]第2065号《关于准予圆信永丰优选价值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《圆信永丰优选价值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1,600,135,209.35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(2020)第0391号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《圆信永丰优选价值混合型证券投资基金基金合同》于2020年5月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,600,255,767.48份基金份额，其中认购资金利息折合120,558.13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《圆信永丰优选价值混合型证券投资基金基金合同》和《圆信永丰优选价值混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据所收取认购/申购、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；投资人在认购/申购时不收取认购/申购费，而是从该类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《圆信永丰优选价值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(包含主板、中小板、创业板及其他依法发行上市的股票)、债券(含国债、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)、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债及其他中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、股指期货、货币市场工具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的相关规定)。基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产60-95%；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。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率 $\times$ 70%+上证国债指数收益率 $\times$ 30%。

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2024年3月26日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《圆信永丰优选价值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2023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2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所

有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 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资产比例计算的金额。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资产比例计算的金额。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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除相关交易费用及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、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的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

本基金同一类别的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净资产转出。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于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**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固

定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	428,027.84	2,627,381.02
等于：本金	427,957.18	2,626,604.44
加：应计利息	70.66	776.58
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	428,027.84	2,627,381.02

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	141,618,794.15	-	126,341,681.59	-15,277,112.56	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,893,066.35	15,115.24	4,049,801.64	141,620.05
	银行间市场	5,148,200.00	207,590.16	5,254,090.16	-101,700.00
	合计	9,041,266.35	222,705.40	9,303,891.80	39,920.05
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	150,660,060.50	222,705.40	135,645,573.39	-15,237,192.51	
项目	上年度末 2022年12月31日				

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	176,826,698.59	-	181,402,824.43	4,576,125.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	157,537.48	10,073,377.48	-18,645.51
	银行间市场	-	-	-
	合计	157,537.48	10,073,377.48	-18,645.51
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	186,761,184.10	157,537.48	191,476,201.91	4,557,480.33

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 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 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	498,904.12	-
银行间市场	-	-
合计	498,904.12	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 其他资产

无。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	17.83	17.49
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	32,041.94	250,135.81
其中：交易所市场	31,886.94	250,135.81
银行间市场	155.00	-
应付利息	-	-
预提费用	184,500.00	184,500.00
合计	216,559.77	434,653.30

注：此处应付赎回费含应付转出费。

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 圆信永丰优选价值A

金额单位：人民币元

项目 (圆信永丰优选价值A)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	139,088,200.46	139,088,200.46
本期申购	3,607,084.25	3,607,084.25
本期赎回（以“-”号填列）	-22,837,131.37	-22,837,131.37
本期末	119,858,153.34	119,858,153.34

##### 7.4.7.7.2 圆信永丰优选价值C

金额单位：人民币元

项目 (圆信永丰优选价值C)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,766,846.63	6,766,846.63
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-400,000.00	-400,000.00
本期末	6,366,846.63	6,366,846.63

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 圆信永丰优选价值A

单位：人民币元

项目 (圆信永丰优选价值A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	99,167,156.04	-54,042,984.90	45,124,171.14
本期期初	99,167,156.04	-54,042,984.90	45,124,171.14
本期利润	-12,660,192.96	-18,895,118.33	-31,555,311.29
本期基金份额交易产生的变动数	-12,933,847.15	8,688,094.13	-4,245,753.02
其中：基金申购款	2,429,252.91	-1,620,447.18	808,805.73
基金赎回款	-15,363,100.06	10,308,541.31	-5,054,558.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,573,115.93	-64,250,009.10	9,323,106.83

##### 7.4.7.8.2 圆信永丰优选价值C

单位：人民币元

项目 (圆信永丰优选价值C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,535,165.76	-2,577,222.85	1,957,942.91
本期期初	4,535,165.76	-2,577,222.85	1,957,942.91
本期利润	-671,130.86	-899,554.51	-1,570,685.37

本期基金份额交易产生的变动数	-268,046.11	141,006.11	-127,040.00
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-268,046.11	141,006.11	-127,040.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,595,988.79	-3,335,771.25	260,217.54

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	7,309.53	13,314.45
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	2,349.27	3,185.07
其他	563.80	450.14
合计	10,222.60	16,949.66

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	153,999,007.82	418,694,989.92
减：卖出股票成本总额	166,355,309.49	424,191,132.99
减：交易费用	394,405.26	1,095,685.19
买卖股票差价收入	-12,750,706.93	-6,591,828.26

#### 7.4.7.11 基金投资收益

无。

**7.4.7.12 债券投资收益****7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	325,225.24	322,875.18
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	97,995.28	78,606.62
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	423,220.52	401,481.80

**7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券(债转股 及债券到期兑付) 成交总额	13,946,461.05	41,794,160.40
减: 卖出债券(债 转股及债券到期兑 付)成本总额	13,526,349.51	40,859,577.80
减: 应计利息总额	321,706.10	855,922.19
减: 交易费用	410.16	53.79
买卖债券差价收入	97,995.28	78,606.62

**7.4.7.13 资产支持证券投资收益**

无。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

无。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

无。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,883,316.70	2,610,680.96
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	1,883,316.70	2,610,680.96

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
1.交易性金融资产	-19,794,672.84	-72,691,873.29
——股票投资	-19,853,238.40	-72,684,823.59
——债券投资	58,565.56	-7,049.70
——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	-19,794,672.84	-72,691,873.29

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
基金赎回费收入	7,526.35	42,488.92
转换费收入	514.19	77.68
合计	8,040.54	42,566.60

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。

#### 7.4.7.19 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	3,271.04	4,440.03
账户维护费	18,000.00	22,500.00
合计	201,271.04	206,940.03

### 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 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,267,855.22	4,227,600.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	641,121.02	915,012.40
应支付基金管理人的净管理费	1,626,734.20	3,312,588.36

注：于2023年8月21日前，支付基金管理人圆信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

根据《圆信永丰基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等事项的公告》，自2023年8月21日起，支付基金管理人圆信永丰基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	377,975.81	704,600.12

注：于2023年8月21日前，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0.25%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×0.25%/当年天数。

根据《圆信永丰基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等事项的公告》，自2023年8月21日起，支付基金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

单位：人民币元

获得销售	本期

服务费的各关联方名称	2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	圆信永丰优选价值A	圆信永丰优选价值C	合计
中国工商银行	0.00	9,300.09	9,300.09
合计	0.00	9,300.09	9,300.09
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	圆信永丰优选价值A	圆信永丰优选价值C	合计
中国工商银行	0.00	10,887.33	10,887.33
合计	0.00	10,887.33	10,887.33

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给圆信永丰基金公司，再由圆信永丰基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日C类基金份额的基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

#### 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**

无。

**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 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	428,027.84	7,309.53	2,627,381.02	13,314.45

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--固定净值型货币市场基金之外的基金**

无。

**7.4.12 期末（2023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	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
301487	盟固利	2023-08-01	6个月以上	创业板打新限售	5.32	40.95	867	4,612.44	35,503.65	-

301526	国际复材	2023-12-19	6个月以上	创业板打新限售	2.66	5.26	2,129	5,663.14	11,198.54	-
301516	中远通	2023-12-01	6个月以上	创业板打新限售	6.87	20.06	486	3,338.82	9,749.16	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	创业板打新限售	8.90	27.95	340	3,026.00	9,503.00	-
301381	赛维时代	2023-07-05	6个月以上	创业板打新限售	20.45	29.67	299	6,114.55	8,871.33	-
301558	三态股份	2023-09-21	6个月以上	创业板打新限售	7.33	13.67	554	4,060.82	7,573.18	-
301413	安培龙	2023-12-11	6个月以上	创业板打新限售	33.25	70.25	107	3,557.75	7,516.75	-
301370	国科恒泰	2023-07-03	6个月以上	创业板打新限售	13.39	16.00	441	5,904.99	7,056.00	-
301499	维科精密	2023-07-13	6个月以上	创业板打新限售	19.50	28.90	237	4,621.50	6,849.30	-
688603	天承	2023-06-3	6个月以	科创	55.00	74.10	84	4,620.00	6,224.40	-

	科技	0	上	板打 新限售							
3015 08	中机 认检	2023 -11-2 3	6个月以 上	创业 板打 新限售	16.82	32.25	190	3,19 5.80	6,12 7.50	-	
3014 89	思泉 新材	2023 -10-1 6	6个月以 上	创业 板打 新限售	41.66	67.77	82	3,41 6.12	5,55 7.14	-	
3015 68	思泰 克	2023 -11-2 1	6个月以 上	创业 板打 新限售	23.23	43.26	128	2,97 3.44	5,53 7.28	-	
3015 07	民生 健康	2023 -08-2 4	6个月以 上	创业 板打 新限售	10.00	15.85	346	3,46 0.00	5,48 4.10	-	
3015 17	陕西 华达	2023 -10-0 9	6个月以 上	创业 板打 新限售	26.87	51.90	104	2,79 4.48	5,39 7.60	-	
3012 91	明阳 电气	2023 -06-2 1	6个月以 上	创业 板打 新限售	38.13	28.20	188	7,16 8.44	5,30 1.60	-	
3014 59	丰茂 股份	2023 -12-0 6	6个月以 上	创业 板打 新限售	31.90	44.48	119	3,79 6.10	5,29 3.12	-	
3012 61	恒工 精密	2023 -06-2 9	6个月以 上	创业 板打 新限售	36.90	50.81	102	3,76 3.80	5,18 2.62	-	

				售							
301292	海科新源	2023-06-29	6个月以上	创业板打新限售	19.99	19.33	261	5,217.39	5,045.13	-	
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月以上	创业板打新限售	48.94	74.43	67	3,278.98	4,986.81	-	
301511	德福科技	2023-08-08	6个月以上	创业板打新限售	28.00	22.67	211	5,908.00	4,783.37	-	
301251	威尔高	2023-08-30	6个月以上	创业板打新限售	28.88	34.64	135	3,898.80	4,676.40	-	
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月以上	创业板打新限售	25.82	31.77	147	3,795.54	4,670.19	-	
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月以上	创业板打新限售	37.56	43.58	99	3,718.44	4,314.42	-	
301418	协昌科技	2023-08-10	6个月以上	创业板打新限售	51.88	50.22	85	4,409.80	4,268.70	-	
301393	昊帆生物	2023-07-05	6个月以上	创业板打新限售	67.68	59.34	71	4,805.28	4,213.14	-	

301529	福赛科技	2023-08-31	6个月以上	创业板打新限售	36.60	37.88	95	3,477.00	3,598.60	-
301559	中集环科	2023-09-26	6个月以上	创业板打新限售	24.22	18.25	188	4,553.36	3,431.00	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月以上	创业板打新限售	23.97	20.89	161	3,859.17	3,363.29	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月以上	创业板打新限售	31.16	28.26	117	3,645.72	3,306.42	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月以上	创业板打新限售	67.88	52.74	58	3,937.04	3,058.92	-
001239	永达股份	2023-12-04	6个月以上	深交所打新限售	12.05	21.94	135	1,626.75	2,961.90	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6个月以上	创业板打新限售	66.80	59.03	47	3,139.60	2,774.41	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月以上	深交所打新限售	53.63	84.62	31	1,662.53	2,623.22	-
001358	兴欣	2023-12-1	6个月以	深交	41.00	46.28	39	1,599.00	1,804.92	-



	新材	4	上	所打 限售						
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	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
113069	博23转债	2023-12-25	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	6,040	604,000.00	604,039.72	-

注1：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

注3：基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

注4：基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

#### 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

本基金属于混合型基金，属于较高预期风险、较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。股票投资比例为60-95%，在业绩比较基准中股票投资部分权重为70%，其余为债券投资部分。在严格控制风险的基础上，本基金通过灵活的资产配置，充分挖掘各类金融工具的潜在投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。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(包含主板、中小板、创业板及其他依法发行上市的股票)、债券(含国债、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)、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债及其他中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款、同业存单、资产支持证券、股指期货、货币市场工具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的相关规定)。

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	2,010,465.75	-
合计	2,010,465.75	-

注:未评级债券为国债。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	2,039,335.89	-
未评级	5,254,090.16	10,073,377.48
合计	7,293,426.05	10,073,377.48

注:未评级债券为政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 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2023年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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

资产的公允价值。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2023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0.61%。

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2023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135,413,726.79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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年1	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2月31日					
资产					
货币资金	428,027.84	-	-	-	428,027.84
结算备付金	28,381.00	-	-	-	28,381.00
存出保证金	11,404.50	-	-	-	11,404.50
交易性金融资产	7,264,555.91	2,039,335.89	-	126,341,681.59	135,645,573.39
应收清算款	-	-	-	158,176.72	158,176.72
应收申购款	-	-	-	3,866.33	3,866.33
资产总计	7,732,369.25	2,039,335.89	-	126,503,724.64	136,275,429.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	88,766.90	88,766.90
应付管理人报酬	-	-	-	134,913.79	134,913.79
应付托管费	-	-	-	22,485.64	22,485.64
应付销售服务费	-	-	-	4,374.82	4,374.82
应交税费	-	-	-	4.52	4.52
其他负债	-	-	-	216,559.77	216,559.77
负债总计	-	-	-	467,105.44	467,105.44
利率敏感度缺口	7,732,369.25	2,039,335.89	-	126,036,619.20	135,808,324.34

上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,627,381.02	-	-	-	2,627,381.02
结算备付金	369,036.57	-	-	-	369,036.57
存出保证金	19,556.33	-	-	-	19,556.33
交易性金融资产	10,073,377.48	-	-	181,402,824.43	191,476,201.91
买入返售金融资产	498,904.12	-	-	-	498,904.12
应收清算款	-	-	-	3,938,046.48	3,938,046.48
应收申购款	-	-	-	11,022.22	11,022.22
资产总计	13,588,255.52	-	-	185,351,893.13	198,940,148.65
负债					
应付清算款	-	-	-	5,143,224.58	5,143,224.58
应付赎回款	-	-	-	103,665.87	103,665.87
应付管理人报酬	-	-	-	270,435.56	270,435.56
应付托管费	-	-	-	45,072.60	45,072.60
应付销售服务费	-	-	-	5,933.99	5,933.99

应交税费	-	-	-	1.61	1.61
其他负债	-	-	-	434,653.30	434,653.30
负债总计	-	-	-	6,002,987.51	6,002,987.51
利率敏感度缺口	13,588,255.52	-	-	179,348,905.62	192,937,161.14

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2023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净资产的比例为6.85%(2022年12月31日：5.22%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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，股票投资比例为基金资产60-95%；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。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 2023年12月31日		上年度末 2022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	126,341,681.59	93.03	181,402,824.43	94.02
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	126,341,681.59	93.03	181,402,824.43	94.02

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1.沪深300指数上升5%	6,153,566.78	10,995,974.35
	2.沪深300指数下降5%	-6,153,566.78	-10,995,974.35

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 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。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	127,559,170.65	180,812,486.72
第二层次	7,868,595.63	10,073,377.48
第三层次	217,807.11	590,337.71
合计	135,645,573.39	191,476,201.91

#### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	交易性金融资产	合计

	债券投资	股票投资	
期初余额	-	590,337.71	590,337.71
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	419,715.42	419,715.42
转出第三层次	-	1,047,306.13	1,047,306.13
当期利得或损失总额	-	255,060.11	255,060.11
其中：计入损益的利得或损失	-	255,060.11	255,060.11
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	217,807.11	217,807.11
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	79,186.52	79,186.52
项目	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,261,395.38	1,261,395.38
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,795,543.68	1,795,543.68
转出第三层次	-	2,546,861.61	2,546,861.61
当期利得或损失总额	-	80,260.26	80,260.26
其中：计入损益的利得或损失	-	80,260.26	80,260.26
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	590,337.71	590,337.71

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-45,232.44	-45,232.44
--	---	------------	------------

注1：于2023年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2023年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

注2：计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期内股票投资	217,807.11	平均价格亚式期权模型	预期波动率	19.8767%-8 1.4228%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期内股票投资	590,337.71	平均价格亚式期权模型	预期波动率	20.8260%-8 7.9166%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023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(2022年12月31日：同)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## §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	126,341,681.59	92.71
	其中：股票	126,341,681.59	92.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,303,891.80	6.83
	其中：债券	9,303,891.80	6.83
	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	456,408.84	0.33
8	其他各项资产	173,447.55	0.13
9	合计	136,275,429.78	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11,197,097.00	8.24
B	采矿业	4,359,754.00	3.21
C	制造业	96,535,835.68	71.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	23,500.51	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	3,203,720.00	2.36

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,702,108.98	4.93
J	金融业	2,952,936.00	2.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,366,729.42	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	126,341,681.59	93.03

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	7,300	12,599,800.00	9.28
2	300750	宁德时代	48,497	7,917,620.22	5.83
3	002475	立讯精密	212,086	7,306,362.70	5.38
4	000568	泸州老窖	32,900	5,902,918.00	4.35
5	002311	海大集团	117,587	5,280,832.17	3.89
6	002179	中航光电	132,860	5,181,540.00	3.82
7	002791	坚朗五金	121,683	4,926,944.67	3.63
8	300124	汇川技术	73,400	4,634,476.00	3.41
9	601899	紫金矿业	349,900	4,359,754.00	3.21

10	601137	博威合金	277,300	4,306,469.00	3.17
11	300498	温氏股份	214,400	4,300,864.00	3.17
12	603187	海容冷链	279,860	4,242,677.60	3.12
13	000858	五粮液	28,400	3,984,804.00	2.93
14	002714	牧原股份	94,400	3,887,392.00	2.86
15	600760	中航沈飞	90,040	3,797,887.20	2.80
16	600585	海螺水泥	149,000	3,361,440.00	2.48
17	688301	奕瑞科技	10,169	3,307,568.94	2.44
18	002352	顺丰控股	79,300	3,203,720.00	2.36
19	603477	巨星农牧	80,300	3,008,841.00	2.22
20	601939	建设银行	453,600	2,952,936.00	2.17
21	603338	浙江鼎力	56,900	2,911,573.00	2.14
22	688188	柏楚电子	11,078	2,803,952.58	2.06
23	600600	青岛啤酒	35,900	2,683,525.00	1.98
24	000596	古井贡酒	11,200	2,607,360.00	1.92
25	002028	思源电气	47,800	2,487,512.00	1.83
26	600406	国电南瑞	98,720	2,203,430.40	1.62
27	603298	杭叉集团	88,000	2,189,440.00	1.61
28	688033	天宜上佳	115,430	1,950,767.00	1.44
29	002043	兔宝宝	198,100	1,755,166.00	1.29
30	300682	朗新集团	103,400	1,694,726.00	1.25
31	301039	中集车辆	169,200	1,587,096.00	1.17
32	300737	科顺股份	232,400	1,426,936.00	1.05
33	300416	苏试试验	73,900	1,357,543.00	1.00
34	301487	盟固利	867	35,503.65	0.03
35	301526	国际复材	2,129	11,198.54	0.01
36	301516	中远通	486	9,749.16	0.01
37	301566	达利凯普	340	9,503.00	0.01
38	301381	赛维时代	299	8,871.33	0.01
39	301558	三态股份	554	7,573.18	0.01
40	301413	安培龙	107	7,516.75	0.01

41	301370	国科恒泰	441	7,056.00	0.01
42	301499	维科精密	237	6,849.30	0.01
43	688603	天承科技	84	6,224.40	0.00
44	301508	中机认检	190	6,127.50	0.00
45	301489	思泉新材	82	5,557.14	0.00
46	301568	思泰克	128	5,537.28	0.00
47	301507	民生健康	346	5,484.10	0.00
48	301517	陕西华达	104	5,397.60	0.00
49	301291	明阳电气	188	5,301.60	0.00
50	301459	丰茂股份	119	5,293.12	0.00
51	301261	恒工精密	102	5,182.62	0.00
52	301292	海科新源	261	5,045.13	0.00
53	301578	辰奕智能	67	4,986.81	0.00
54	301511	德福科技	211	4,783.37	0.00
55	301251	威尔高	135	4,676.40	0.00
56	301202	朗威股份	147	4,670.19	0.00
57	301550	斯菱股份	99	4,314.42	0.00
58	301418	协昌科技	85	4,268.70	0.00
59	301393	昊帆生物	71	4,213.14	0.00
60	301529	福赛科技	95	3,598.60	0.00
61	301559	中集环科	188	3,431.00	0.00
62	301500	飞南资源	161	3,363.29	0.00
63	301515	港通医疗	117	3,306.42	0.00
64	301520	万邦医药	58	3,058.92	0.00
65	001239	永达股份	135	2,961.90	0.00
66	301548	崇德科技	47	2,774.41	0.00
67	001306	夏厦精密	31	2,623.22	0.00
68	001358	兴欣新材	39	1,804.92	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	600309	万华化学	6,516,784.00	3.38
2	300498	温氏股份	5,920,682.00	3.07
3	601137	博威合金	5,905,499.00	3.06
4	300769	德方纳米	5,868,829.00	3.04
5	002179	中航光电	5,822,537.32	3.02
6	002714	牧原股份	4,785,176.49	2.48
7	601939	建设银行	4,712,603.00	2.44
8	601333	广深铁路	4,602,529.00	2.39
9	601899	紫金矿业	4,160,670.00	2.16
10	600004	白云机场	4,106,769.00	2.13
11	600760	中航沈飞	3,907,595.20	2.03
12	600585	海螺水泥	3,357,521.00	1.74
13	603477	巨星农牧	3,203,296.00	1.66
14	000786	北新建材	3,177,526.00	1.65
15	603338	浙江鼎力	3,083,517.00	1.60
16	300682	朗新集团	2,928,912.00	1.52
17	600731	湖南海利	2,893,491.00	1.50
18	601888	中国中免	2,878,906.00	1.49
19	000059	华锦股份	2,720,694.00	1.41
20	600702	舍得酒业	2,637,367.00	1.37

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	601888	中国中免	7,378,538.98	3.82
2	600763	通策医疗	7,140,688.00	3.70
3	603288	海天味业	6,366,041.79	3.30
4	600426	华鲁恒升	6,039,455.46	3.13
5	002008	大族激光	5,744,212.36	2.98
6	600309	万华化学	5,425,749.00	2.81
7	601333	广深铁路	5,060,127.00	2.62
8	300769	德方纳米	5,023,405.00	2.60
9	300986	志特新材	4,864,745.92	2.52
10	002812	恩捷股份	4,631,766.70	2.40
11	000333	美的集团	4,470,446.94	2.32
12	300054	鼎龙股份	4,146,577.00	2.15
13	300014	亿纬锂能	3,571,056.00	1.85
14	600004	白云机场	3,558,779.00	1.84
15	603737	三棵树	3,506,412.30	1.82
16	601677	明泰铝业	3,272,000.56	1.70
17	600754	锦江酒店	3,261,979.00	1.69
18	000786	北新建材	3,003,004.00	1.56
19	601857	中国石油	2,785,816.00	1.44
20	603170	宝立食品	2,770,327.00	1.44

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	131,147,405.05
卖出股票收入（成交）总额	153,999,007.82

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,010,465.75	1.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,254,090.16	3.87
	其中：政策性金融债	5,254,090.16	3.87
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)	2,039,335.89	1.50
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,303,891.80	6.85

#### 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	140211	14国开11	50,000	5,254,090.16	3.87
2	019709	23国债16	20,000	2,010,465.75	1.48
3	118025	奕瑞转债	10,080	1,435,296.17	1.06
4	113069	博23转债	6,040	604,039.72	0.44

#### 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

根据基金合同约定，本基金不参与权证投资。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

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

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

**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	11,404.50
2	应收清算款	158,176.72
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,866.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	173,447.55

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118025	奕瑞转债	1,435,296.17	1.06

**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

份额级别	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
圆信永丰优选价值A	2,316	51,752.23	34,024,396.19	28.39%	85,833,757.15	71.61%
圆信永丰优选价值C	7	909,549.52	0.00	0.00%	6,366,846.63	100.00%
合计	2,323	54,337.06	34,024,396.19	26.96%	92,200,603.78	73.04%

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	份额级别	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	圆信永丰优选价值A	402,305.16	0.34%
	圆信永丰优选价值C	-	-

	合计	402,305.16	0.32%
--	----	------------	-------

### 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	份额级别	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	圆信永丰优选价值A	0~10
	圆信永丰优选价值C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	圆信永丰优选价值A	10~50
	圆信永丰优选价值C	0
	合计	10~50

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

	圆信永丰优选价值A	圆信永丰优选价值C
基金合同生效日(2020年05月18日)基金份额总额	1,541,990,275.24	58,265,492.24
本报告期期初基金份额总额	139,088,200.46	6,766,846.63
本报告期基金总申购份额	3,607,084.25	-
减：本报告期基金总赎回份额	22,837,131.37	400,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	119,858,153.34	6,366,846.63

### §11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，未召开基金份额持有人大会且无决议。

#### 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

报告期内，基金管理人的重大人事变动：

蔡炎坤先生于2023年6月20日离任公司总经理，同日，胡荣炜先生代任公司总经理。高健女士于2023年11月1日担任公司总经理，同日，胡荣炜先生不再代任公司总经理。报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期内应支付审计费用6万元。该审计机构已提供审计服务的持续年限为4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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人及其高级管理人员均未受稽查或处罚。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人及其高级管理人员均未受稽查或处罚。

### 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	17,803,005.14	6.35%	13,060.09	5.66%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

东吴证券	2	10,719,417.85	3.82%	7,841.31	3.40%	-
光大证券	2	28,656,883.67	10.22%	18,298.60	7.92%	-
国金证券	2	30,071,852.60	10.73%	22,003.68	9.53%	-
国泰君安	2	13,615,369.50	4.86%	12,680.36	5.49%	-
国投证券	2	38,828,592.19	13.85%	36,283.64	15.71%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	50,303,548.43	17.95%	46,848.37	20.29%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	13,260,361.58	4.73%	12,349.21	5.35%	-
天风证券	2	49,352,870.49	17.61%	36,346.59	15.74%	-
西南证券	2	2,013,897.52	0.72%	1,271.31	0.55%	-
招商证券	2	171,614.25	0.06%	159.82	0.07%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	22,402,824.07	7.99%	20,866.21	9.04%	-
中信证券	2	3,094,903.28	1.10%	2,927.52	1.27%	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-



注1：截止本报告期末，本基金已有36个交易日。本报告期内基金减少1个证券公司交易单元，为野村东方国际证券有限公司深交所交易单元。

注2：本基金管理人负责选择证券经营机构，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；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	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	100,190.00	1.15%	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	1,500,000.00	60.00%	-	-	-	-
国投证券	3,491,197.00	40.04%	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	400,033.00	4.59%	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	3,395,846.73	38.94%	1,000,000.00	40.00%	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	600,285.00	6.88%	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	732,604.82	8.40%	-	-	-	-	-	-

### 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	圆信永丰优选价值混合型证券投资基金2022年第四季度报告	证监会规定媒介	2023-01-20
2	圆信永丰基金管理有限公司关于完成公司法定代表人变更登记的公告	证监会规定媒介	2023-01-20
3	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、转换转入、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	2023-03-09
4	圆信永丰优选价值混合型证券投资基金2022年年度报告	证监会规定媒介	2023-03-31
5	圆信永丰优选价值混合型证券投资基金2023年第一季度报告	证监会规定媒介	2023-04-21
6	圆信永丰基金管理有限公司圆信永丰优选价值混合型证券投资基金招募说明书（更新）	证监会规定媒介	2023-06-17
7	圆信永丰基金管理有限公司	证监会规定媒介	2023-06-21

	基金行业高级管理人员变更公告		
8	圆信永丰优选价值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	2023-06-30
9	圆信永丰优选价值混合型证券投资基金2023年第二季度报告	证监会规定媒介	2023-07-21
10	圆信永丰优选价值混合型证券投资基金托管协议更新	证监会规定媒介	2023-08-19
11	圆信永丰优选价值混合型证券投资基金基金合同更新	证监会规定媒介	2023-08-19
12	圆信永丰优选价值混合型证券投资基金招募说明书（更新）	证监会规定媒介	2023-08-22
13	圆信永丰优选价值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	2023-08-22
14	圆信永丰优选价值混合型证券投资基金2023年中期报告	证监会规定媒介	2023-08-31
15	圆信永丰优选价值混合型证券投资基金2023年第三季度报告	证监会规定媒介	2023-10-25
16	圆信永丰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2023-11-03

## §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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

机构	1	20230101-20231231	34,020,829.86	0.00	0.00	34,020,829.86	26.95%
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选价值混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《圆信永丰优选价值混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《圆信永丰优选价值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。

### 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

二〇二四年三月二十九日