

# 永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 年半年度报告摘要

2019 年 06 月 30 日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 26 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。本半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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	永赢惠添利灵活配置混合
基金主代码	005711
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年05月31日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	918,017,394.66份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金的投资策略分为两方面：一方面体现在采取“自上而下”的方式对权益类、固定收益类等不同类别资产进行大类配置；另一方面体现在对单个投资品种的精选上。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>在灵活的类别资产配置的基础上，本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结</p>

合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。

### 3、固定收益投资策略

本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。

### 4、中小企业私募债投资策略

本基金对中小企业私募债的投资主要围绕久期、流动性和信用风险三方面展开。久期控制方面，根据宏观经济运行状况的分析和预判，灵活调整组合的久期。信用风险控制方面，对个券信用资质进行详尽的分析，对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考量，尽可能地缩小信用风险暴露。流动性控制方面，要根据中小企业私募债整体的流动性情况来调整持仓规模，在力求获取较高收益的同时确保整体组合的流动性安全。

### 5、可转换债券投资策略

本基金在综合分析可转债的股性特征、债性特征、流动性等因素的基础上，审慎筛选其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好，以及基础股票基本面优良的品种，并以合理的价格买入，争取稳健的投资回报。

### 6、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

### 7、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等

	<p>多种因素，对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。</p> <p>8、股指期货投资策略</p> <p>基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中风险和中等预期收益产品。

### 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	永赢基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	毛慧
	联系电话	021-51690145
	电子邮箱	maoh@maxwealthfund.com
客户服务电话	021-51690111	95559
传真	021-51690177	021-62701216

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网	www.maxwealthfund.com
----------------------	-----------------------

网址	
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道210号21世纪中心大厦27楼

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019年01月01日- 2019年06月30日）
本期已实现收益	197,141,657.09
本期利润	218,545,106.74
加权平均基金份额本期利润	0.3102
本期基金份额净值增长率	44.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2019年06月30日）
期末可供分配基金份额利润	0.3153
期末基金资产净值	1,260,762,742.64
期末基金份额净值	1.3734

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

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.20%	1.37%	2.92%	0.59%	4.28%	0.78%
过去三	-0.14%	1.59%	-0.06%	0.77%	-0.08%	0.82%

个月						
过去六个月	44.02%	1.67%	14.27%	0.78%	29.75%	0.89%
过去一年	39.15%	1.58%	7.61%	0.76%	31.54%	0.82%
自基金合同生效起至今	37.34%	1.52%	4.79%	0.76%	32.55%	0.76%

注：1、上述基金业绩指标不包括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；

2、本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率\*50%+上证国债指数收益率\*50%。

### 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

永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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

永赢基金管理有限公司（以下简称“公司”）于2013年10月8日取得了中国证监会《关于核准设立永赢基金管理有限公司的批复》（证监许可[2013]1280号），随后，公司于2013年10月11日取得商务部《中华人民共和国外商投资企业批准证书》（商外资资审字[2013]008号），并于2013年11月7日在国家工商行政管理总局注册成立，此后，于2013年11月12日取得中国证监会核发的《基金管理资格证书》（编号A087），并于2017年3月14日获得中国证监会颁发的信用代码为913302007178854322的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。2014年8月18日，公司完成工商变更登记，注册资本由人民币壹点伍亿元增至人民币贰亿元；2018年1月25日，公司完成增资，注册资本由人民币贰亿元增至人民币玖亿元。目前，公司的股权结构为宁波银行股份有限公司持股71.49%，利安资金管理公司持股28.51%。

截止2019年6月30日，本基金管理人共管理39只开放式证券投资基金，即永赢货币市场基金、永赢稳益债券型证券投资基金、永赢双利债券型证券投资基金、永赢丰益债券型证券投资基金、永赢添益债券型证券投资基金、永赢瑞益债券型证券投资基金、永赢天天利货币市场基金、永赢永益债券型证券投资基金、永赢丰利债券型证券投资基金、永赢增益债券型证券投资基金、永赢恒益债券型证券投资基金、永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠益债券型证券投资基金、永赢泰益债券型证券投资基金、永赢润益债券型证券投资基金、永赢聚益债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、永赢盛益债券型证券投资基金、永赢嘉益债券型证券投资基金、永赢裕益债券型证券投资基金、永赢祥益债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、永赢诚益债券型证券投资基金、永赢通益债券型证券投资基金、永赢昌益债券型证券投资基金、永赢宏益债券型证券投资基金、永赢伟益债券型证券投资基金、永赢颐利债券型证券投资基金、永赢迅利中高等级短债债券型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、永赢中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、永赢泰利债券型证券投资基金、永赢悦利债券型证券投资基金、永赢卓利债券型证券投资基金、永赢凯利债券型证券投资基金、永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金以及永赢智益纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

### 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		



李永兴	副总经理/ 基金经理	2018-05-31	-	13	李永兴先生，北京大学金融学硕士，13年证券相关从业经验，曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、基金经理；九泰基金管理有限公司投资总监；永赢基金管理有限公司总经理助理。现任永赢基金管理有限公司副总经理。
-----	---------------	------------	---	----	--

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资授权管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先、比例分配”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。

本基金管理人交易部和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，分别于每季度和每年度对所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，每季度对连续四个季度期间内、不同时间窗下不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现显著违反公平交易的行为。本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 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

2019年上半年，A股市场大幅上涨，无论沪深300、中小板还是创业板指数都出现大幅上涨。行业方面，各个行业都出现明显上涨，其中一季度在货币政策放松的背景下非银金融、计算机等估值弹性大的行业涨幅较大；二季度在贸易摩擦升级的背景下食品饮料、医疗服务等消费行业出现上涨。

一季度，本基金基于货币政策放松有利于市场估值提升的投资逻辑，一方面保持了较高的股票仓位，另一方面增加了非银金融和计算机的配置比例，因此取得了较好的投资收益。进入二季度，市场因货币政策微调以及贸易摩擦升级的影响出现调整，本基金也适当降低了仓位，并增加了低估值且盈利稳定的银行、水泥等行业的配置比例，因此在市场下跌过程中跌幅小于指数。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢惠添利灵活配置混合基金份额净值为1.3734元，本报告期内，基金份额净值增长率为44.02%，同期业绩比较基准收益率为14.27%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受贸易摩擦升级、经济仍在下滑过程中等因素的影响，A股市场难以排除短期波动的风险。但是从中长期看，当前A股市场具备很好的投资价值，主要原因在于A股市场无论估值还是盈利从中长期看都具备上升的空间。估值方面，当前A股市场的估值水平位于历史上较低的水平，同时无风险利率也位于历史上较低的水平，这有助于A股市场估值的回升。盈利方面，一季度货币政策的放松对于经济的滞后传导作用将会逐渐开始显现，即便有贸易摩擦的影响预计政府也会出台对冲的政策稳定经济，再加上经济和企业盈利去年四季度基数的下降，预计今年四季度经济和企业盈利有望见底。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。本基金管理人估值委员会成员包括公司总经理、督察长、固定收益投资的分管领导、权益投资的分管领导、基金运营的分管领导、基金运营部负责人、合规部负责人和风险管理部负责人。

以上成员均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

报告期内，本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务；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，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

### § 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

2019上半年度，基金托管人在永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

2019上半年度，永赢基金管理有限公司在永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

2019上半年度，由永赢基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	79,284,784.47	37,302,426.24
结算备付金	2,256,280.85	1,761,145.70
存出保证金	640,889.20	284,152.52
交易性金融资产	1,181,024,514.13	497,915,830.53
其中：股票投资	1,181,024,514.13	497,915,830.53
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	1,119,091.32	4,011,171.64
应收利息	35,999.45	16,974.80
应收股利	-	-
应收申购款	2,808,989.14	839,635.58
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,267,170,548.56	542,131,337.01
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019年06月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-

应付证券清算款	-	6,629,214.94
应付赎回款	3,003,331.70	255,295.47
应付管理人报酬	1,487,694.59	710,781.89
应付托管费	247,949.10	118,463.66
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,525,663.27	439,384.74
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	143,167.26	202,208.78
负债合计	6,407,805.92	8,355,349.48
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	918,017,394.66	559,771,760.77
未分配利润	342,745,347.98	-25,995,773.24
所有者权益合计	1,260,762,742.64	533,775,987.53
负债和所有者权益总计	1,267,170,548.56	542,131,337.01

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.3734元，基金份额总额918,017,394.66份。

## 6.2 利润表

会计主体：永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年05月31日（基金合同生效日）至2018年06月30日
一、收入	230,459,197.66	-6,299,513.51
1. 利息收入	1,057,279.93	1,327,872.23
其中：存款利息收入	670,427.01	866,007.47

债券利息收入	-	5,254.37
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	386,852.92	456,610.39
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	205,022,836.08	-
其中：股票投资收益	191,868,891.14	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资	-	-
收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	13,153,944.94	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	21,403,449.65	-7,627,385.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,975,632.00	-
<b>减：二、费用</b>	11,914,090.92	955,226.86
1. 管理人报酬	6,624,423.59	685,675.85
2. 托管费	1,104,070.60	114,279.30
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,067,740.07	123,181.34
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	9.44
7. 其他费用	117,856.66	32,080.93

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	218,545,106.74	-7,254,740.37
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	218,545,106.74	-7,254,740.37

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	559,771,760.77	-25,995,773.24	533,775,987.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	218,545,106.74	218,545,106.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	358,245,633.89	150,196,014.48	508,441,648.37
其中：1. 基金申购款	874,826,262.54	279,885,250.31	1,154,711,512.85
2. 基金赎回款	-516,580,628.65	-129,689,235.83	-646,269,864.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	918,017,394.66	342,745,347.98	1,260,762,742.64

项 目	上年度可比期间		
	2018年05月31日（基金合同生效日）至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	557,461,468.83	-	557,461,468.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,254,740.37	-7,254,740.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	557,461,468.83	-7,254,740.37	550,206,728.46

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：

芦特尔

郑凌云

虞俏依

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

永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2018]303号《关于准予永赢惠添利



灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由永赢基金管理有限公司作为管理人自2018年5月2日至2018年5月25日期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2018）验字第61090672\_B04号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2018年5月31日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币557,345,008.32元，在募集期间产生的存款利息为人民币116,460.51元，以上实收基金（本息）合计为人民币557,461,468.83元，折合557,461,468.83份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、权证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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%，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，本基金保留的现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*50%+上证国债指数收益率\*50%。

#### 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、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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于2019年6月30日的财务状况以及自2019年1月1日起至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金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。城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 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

本报告期内本公司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。

##### 6.4.7.2 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
永赢基金管理有限公司（“永赢基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金管理人的股东、基金代销机构
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4. 8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4. 8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4. 8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4. 8.2 关联方报酬

##### 6.4. 8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日 至2019年06月30 日	上年度可比期间 2018年05月31日（基金合同 生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,624,423.59	685,675.85
其中：支付销售机构的客户维护费	802,222.19	120,165.27

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

##### 6.4. 8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日 至2019年06月30 日	上年度可比期间 2018年05月31日（基金合同 生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,104,070.60	114,279.30

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 6.4. 8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4. 8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4. 8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年06 月30日	上年度可比期间 2018年05月31日（基金合同 生效日）至2018年06月30日
基金合同生效日（2018年05月31日）持有的基金份额	19,999,900.00	19,999,900.00
报告期初持有的基金份额	19,999,900.00	19,999,900.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	19,999,900.00	19,999,900.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.1786%	3.5877%

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

##### 6.4. 8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年06月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
永赢资产	152,432,413.27	16.6045%	129,999,900.00	23.2237%

## 6.4. 8.5 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 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年05月31日（基金合同生效日）至2018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
交通银行股份有限公司	79,284,784.47	622,478.52	40,664,194.47	212,729.63

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。另外，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2019年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

## 6.4. 8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

## 6.4. 8.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.9 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4. 9.1 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	证券	成功	可流	流通	认购	期末	数量（	期末	期末	备注

代码	名称	认购日	通日	受限类型	价格	估值单价	单位：(股)	成本总额	估值总额	
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	认购新发证券	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	认购新发证券	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，本基金无因从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年06月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.10.1 公允价值

###### 6.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 6.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币1,180,967,537.59元，属于第二层次的余额为人民币56,976.54元，属于第三层次余额为人民币0.00元。

###### 6.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调



整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 6.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于2019年8月23日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	1,181,024,514.13	93.20
	其中：股票	1,181,024,514.13	93.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	81,541,065.32	6.43
8	其他各项资产	4,604,969.11	0.36
9	合计	1,267,170,548.56	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	-	-
B	采矿业	363,431.25	0.03
C	制造业	520,021,275.56	41.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	267,794,578.48	21.24
J	金融业	392,822,122.24	31.16
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	-	-
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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,181,024,514.13	93.68

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期内本基金未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000001	平安银行	4,880,220	67,249,431.60	5.33
2	300059	东方财富	4,717,600	63,923,480.00	5.07
3	601166	兴业银行	3,240,000	59,259,600.00	4.70
4	600801	华新水泥	2,492,440	50,471,910.00	4.00
5	601628	中国人寿	1,764,800	49,979,136.00	3.96
6	600837	海通证券	3,460,100	49,098,819.00	3.89
7	300454	深信服	528,061	46,226,459.94	3.67
8	601688	华泰证券	2,010,400	44,872,128.00	3.56
9	601012	隆基股份	1,890,631	43,692,482.41	3.47
10	600030	中信证券	1,823,900	43,427,059.00	3.44

#### 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	000001	平安银行	66,795,817.92	12.51
2	601166	兴业银行	64,572,336.00	12.10
3	300059	东方财富	64,216,423.10	12.03
4	300454	深信服	53,297,067.16	9.98
5	601628	中国人寿	51,929,308.44	9.73

6	600837	海通证券	46,927,822.00	8.79
7	601336	新华保险	46,739,996.34	8.76
8	600801	华新水泥	42,071,400.52	7.88
9	601688	华泰证券	40,908,999.80	7.66
10	600030	中信证券	40,464,726.36	7.58
11	601601	中国太保	40,111,952.39	7.51
12	601939	建设银行	39,888,401.00	7.47
13	300496	中科创达	38,041,135.65	7.13
14	600585	海螺水泥	36,842,258.61	6.90
15	601012	隆基股份	36,255,354.26	6.79
16	601818	光大银行	35,218,976.00	6.60
17	603990	麦迪科技	34,971,591.21	6.55
18	000401	冀东水泥	34,601,705.07	6.48
19	300450	先导智能	33,099,835.11	6.20
20	601288	农业银行	32,146,982.00	6.02
21	600383	金地集团	32,123,848.82	6.02
22	300033	同花顺	30,353,974.85	5.69
23	002271	东方雨虹	30,058,047.40	5.63
24	600352	浙江龙盛	29,947,504.00	5.61
25	000625	长安汽车	26,568,715.36	4.98
26	600606	绿地控股	26,511,230.00	4.97
27	002410	广联达	26,342,849.92	4.94
28	000063	中兴通讯	26,200,425.24	4.91
29	600031	三一重工	24,277,116.59	4.55
30	300762	上海瀚讯	22,218,037.54	4.16
31	002415	海康威视	21,516,820.49	4.03
32	300567	精测电子	21,312,543.00	3.99
33	000002	万科A	21,079,545.74	3.95
34	000333	美的集团	20,963,288.00	3.93
35	600690	海尔智家	20,955,461.99	3.93
36	000725	京东方A	20,338,988.00	3.81

37	002739	万达电影	19,611,928.90	3.67
38	600438	通威股份	19,429,156.43	3.64
39	600340	华夏幸福	19,201,047.20	3.60
40	600297	广汇汽车	18,291,175.93	3.43
41	600831	广电网络	18,239,444.86	3.42
42	601633	长城汽车	18,024,507.91	3.38
43	600000	浦发银行	18,001,791.13	3.37
44	600048	保利地产	17,405,421.00	3.26
45	603103	横店影视	17,377,198.00	3.26
46	300308	中际旭创	17,355,253.00	3.25
47	000786	北新建材	17,227,216.00	3.23
48	002146	荣盛发展	16,610,820.00	3.11
49	002236	大华股份	16,519,475.13	3.09
50	300014	亿纬锂能	15,960,270.77	2.99
51	600570	恒生电子	15,048,960.02	2.82
52	600529	山东药玻	14,855,483.40	2.78
53	601238	广汽集团	14,127,228.36	2.65
54	000961	中南建设	13,928,335.00	2.61
55	601788	光大证券	13,852,014.00	2.60
56	300747	锐科激光	13,601,560.00	2.55
57	001979	招商蛇口	12,880,575.84	2.41
58	603160	汇顶科技	12,670,719.00	2.37
59	002384	东山精密	12,515,580.37	2.34
60	601229	上海银行	12,027,600.00	2.25
61	002796	世嘉科技	12,010,507.00	2.25
62	002230	科大讯飞	11,819,772.90	2.21
63	603508	思维列控	11,784,655.00	2.21
64	002508	老板电器	11,196,718.57	2.10
65	000651	格力电器	11,194,367.00	2.10
66	601988	中国银行	11,176,399.00	2.09

注：买入金额按买入成交金额（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	600030	中信证券	51,143,943.06	9.58
2	300033	同花顺	47,509,281.83	8.90
3	300059	东方财富	46,312,003.81	8.68
4	000002	万科A	45,079,576.28	8.45
5	600048	保利地产	44,201,561.44	8.28
6	001979	招商蛇口	44,154,056.00	8.27
7	600352	浙江龙盛	41,284,056.00	7.73
8	600837	海通证券	40,584,491.88	7.60
9	601688	华泰证券	38,732,343.03	7.26
10	601939	建设银行	38,112,398.38	7.14
11	601211	国泰君安	34,914,584.16	6.54
12	600031	三一重工	33,997,558.24	6.37
13	600519	贵州茅台	33,387,814.22	6.26
14	601818	光大银行	32,439,235.92	6.08
15	600383	金地集团	31,843,358.90	5.97
16	600340	华夏幸福	31,039,402.03	5.82
17	601288	农业银行	30,747,555.70	5.76
18	601155	新城控股	27,409,798.51	5.14
19	000776	广发证券	27,073,649.18	5.07
20	600606	绿地控股	26,583,446.00	4.98
21	600831	广电网络	24,701,399.01	4.63
22	300413	芒果超媒	24,160,135.45	4.53
23	603508	思维列控	23,618,778.57	4.42
24	300567	精测电子	23,432,321.00	4.39

25	002739	万达电影	20,772,686.32	3.89
26	600297	广汇汽车	19,676,543.37	3.69
27	601788	光大证券	19,460,358.78	3.65
28	603103	横店影视	19,133,031.99	3.58
29	600529	山东药玻	18,723,779.99	3.51
30	000961	中南建设	17,649,736.18	3.31
31	600000	浦发银行	17,166,390.28	3.22
32	002146	荣盛发展	16,793,124.00	3.15
33	000596	古井贡酒	16,737,317.79	3.14
34	300014	亿纬锂能	16,378,753.00	3.07
35	600582	天地科技	15,713,586.74	2.94
36	300188	美亚柏科	14,782,428.81	2.77
37	002410	广联达	14,045,598.75	2.63
38	601111	中国国航	13,168,060.31	2.47
39	600029	南方航空	13,039,174.36	2.44
40	000858	五粮液	12,576,077.00	2.36
41	000063	中兴通讯	12,439,945.00	2.33
42	600115	东方航空	12,189,262.95	2.28
43	600809	山西汾酒	11,380,883.02	2.13
44	601988	中国银行	10,706,058.63	2.01

注：卖出金额按卖出成交金额（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	1,875,681,242.58
卖出股票收入（成交）总额	1,405,844,899.77

注：买入股票成本、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

本基金本报告期末未持有债券。

**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**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期内未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 本报告期内,基金投资的前十名证券的发行主体平安银行股份有限公司在报告编制日前一年受到行政处罚,处罚金额合计为140万元。本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

**7.12.2** 基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	640,889.20
2	应收证券清算款	1,119,091.32



3	应收股利	-
4	应收利息	35,999.45
5	应收申购款	2,808,989.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,604,969.11

#### 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的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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
23,038	39,847.96	580,600,783.04	63.2451%	337,416,611.62	36.7549%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,285,575.09	0.36%

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年05月31日)基金份额总额	557,461,468.83
本报告期期初基金份额总额	559,771,760.77
本报告期基金总申购份额	874,826,262.54
减：本报告期基金总赎回份额	516,580,628.65
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	918,017,394.66

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金管理人未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《基金合同》及《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	966,955,896.17	29.49%	698,743.30	29.47%	-
中金公司	2	-	-	-	-	新增
国信证券	2	368,991,200.80	11.25%	266,180.30	11.23%	-
广发证券	2	595,732,919.03	18.17%	430,566.35	18.16%	-
天风证券	2	-	-	-	-	新增
东方财富	2	215,677,184.90	6.58%	156,651.45	6.61%	新增
安信证券	2	1,131,602,492.94	34.51%	818,879.64	34.54%	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由本基金管理人董事会授权管理层批准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	1,090,000.00	31.82%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	940,000.00	27.45%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	1,395,000.00	40.73%	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101 - 20190424	19,999,900.00	0.00	0.00	19,999,900.00	2.18%
	2	20190213 - 2	229,999,80	22,432,513.	0.00	252,432,31	27.50%

		0190218	0.00	27		3.27	
	3	20190603 - 2 0190620	229,999,80	22,432,513. 27	0.00	252,432,31 3.27	27.50%
	4	20190621 - 2 0190630	0.00	201,385,707 .25	0.00	201,385,70 7.25	21.94%
产品特有风险							
<p>本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，存在可能因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、巨额赎回风险、净值波动风险以及因巨额赎回造成基金规模持续低于正常水平而面临转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等特有风险。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

永赢基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十六日