

# 永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金

## 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2020 年 03 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2020年03月24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。

本报告中财务资料经审计。

本报告期自2019年07月09日（基金合同生效日）起至2019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	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	18
4.10 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	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
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	19
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	72
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	73
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	73
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	73

8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	73
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12	投资组合报告附注	73
§9	基金份额持有人信息	75
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	75
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	76
§10	开放式基金份额变动	76
§11	重大事件揭示	77
11.1	基金份额持有人大会决议	77
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	77
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4	基金投资策略的改变	77
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	77
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	77
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8	其他重大事件	78
§12	影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	81
§13	备查文件目录	81
13.1	备查文件目录	81
13.2	存放地点	82
13.3	查阅方式	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金	
基金简称	永赢沪深300	
基金主代码	007538	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年07月09日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
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	299,545,441.46份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢沪深300A	永赢沪深300C
下属分级基金的交易代码	007538	007539
报告期末下属分级基金的份额总额	268,486,762.10份	31,058,679.36份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	<p>正常情况下，本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>通常情形下，本基金主要采取完全复制法进行投资，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重分配投资于每只股票的具体金额，进而形成股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票发生增发或配股、成份股停牌或因法律法规原因被限制投资、市场流动性不足等情况，对股票投资组合进行实时调整，力争基金净值增长率与标的指数收</p>

益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

(1) 定期调整：根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

(2) 不定期调整

①当标的指数成份股发生增发、配股等股权变动而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

②根据基金申购赎回情况，调整股票投资组合，以有效跟踪标的指数；

③根据法律法规规定，成份股在标的指数中的权重因其他原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当的调整，力争降低跟踪误差。

## 2、债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过主要采取组合久期配置策略，同时辅之以收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

## 3、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。

## 4、其他金融工具投资策略

(1) 权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

(2) 股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对

	<p>证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。</p> <p>基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> <p>5、融资及转融通证券出借业务投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</p>
业绩比较基准	$\text{沪深300指数收益率} \times 95\% + \text{银行活期存款利率} \text{ (税后)} \times 5\%$
风险收益特征	<p>本基金是股票型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型证券投资基金、货币市场基金和混合型证券投资基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数，以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>

### 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		中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	毛慧	郭明
	联系电话	021-51690145	(010) 66105799
	电子邮箱	maoh@maxwealthfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	021-51690111	95588	
传真	021-51690177	(010) 66105798	
注册地址	浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	北京市西城区复兴门内大街5号	
办公地址	上海市浦东新区世纪大道210号21世纪中心大厦27楼	北京市西城区复兴门内大街5号	
邮政编码	200120	100140	
法定代表人	马宇晖	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	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道210号21世纪中心大厦27楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	永赢基金管理有限公司	上海市世纪大道210号21世纪中心大厦27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	本期2019年07月09日（基金合同生效日）- 2019年12月31日	
	永赢沪深300A	永赢沪深300C
本期已实现收益	8,879,708.31	571,781.70
本期利润	27,702,473.67	1,790,315.03
加权平均基金份额本期利润	0.1186	0.1196
本期加权平均净值利润率	11.48%	11.44%
本期基金份额净值增长率	9.67%	9.60%
3.1.2 期末数据和指标	2019年末	
期末可供分配利润	10,112,932.18	1,149,017.94
期末可供分配基金份额利润	0.0377	0.0370
期末基金资产净值	294,445,763.83	34,040,079.12
期末基金份额净值	1.0967	1.0960
3.1.3 累计期末指标	2019年末	
基金份额累计净值增长率	9.67%	9.60%

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、期末可供分配利润为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；

4、本基金合同生效日为2019年7月9日，截至本报告期末本基金合同生效未满1年。

### 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

永赢沪深300A

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	7.99%	0.69%	7.02%	0.70%	0.97%	-0.01%
自基金合同生效起至今	9.67%	0.75%	7.35%	0.76%	2.32%	-0.01%

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\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%。  
永赢沪深300C

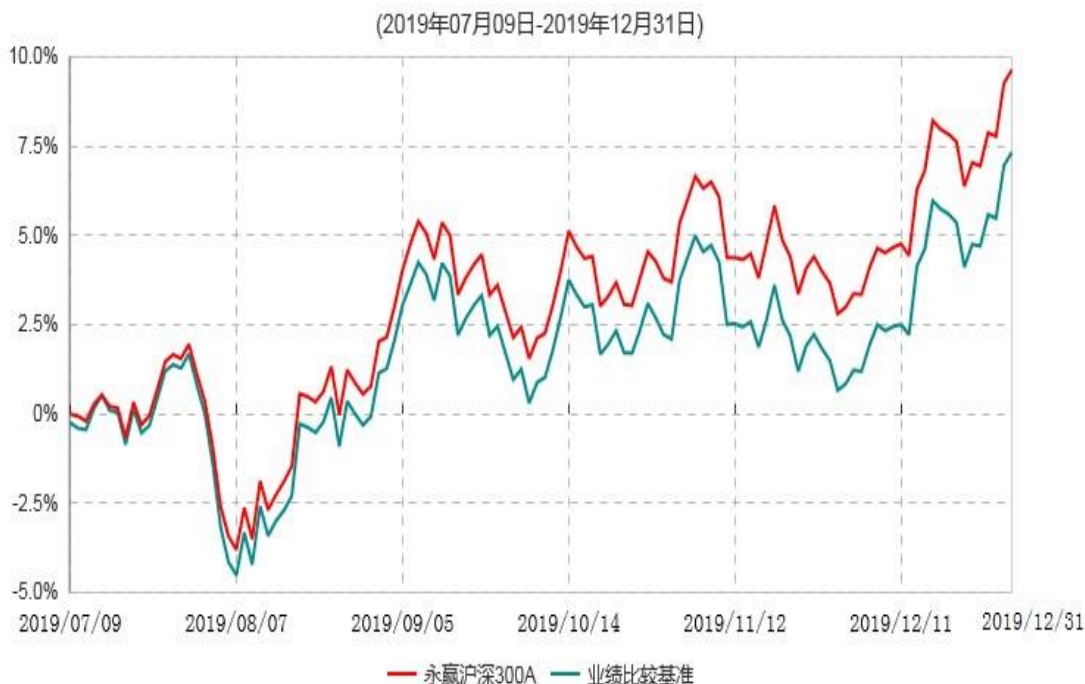
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.96%	0.69%	7.02%	0.70%	0.94%	-0.01%
自基金合同生效起至今	9.60%	0.75%	7.35%	0.76%	2.25%	-0.01%

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\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%。

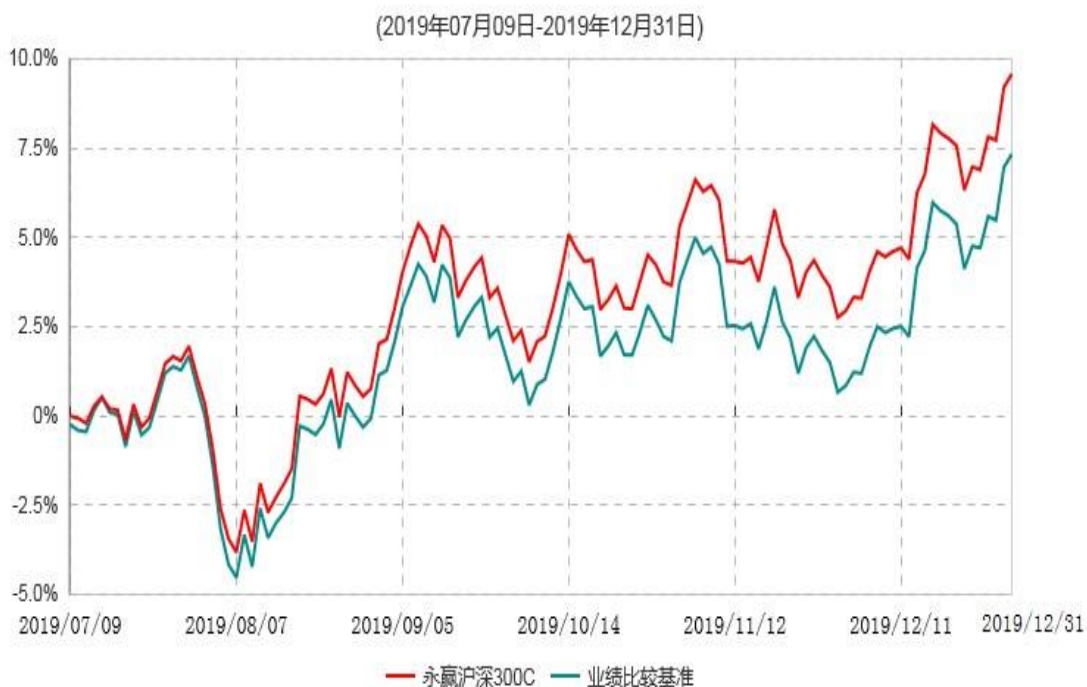
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

永赢沪深300A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



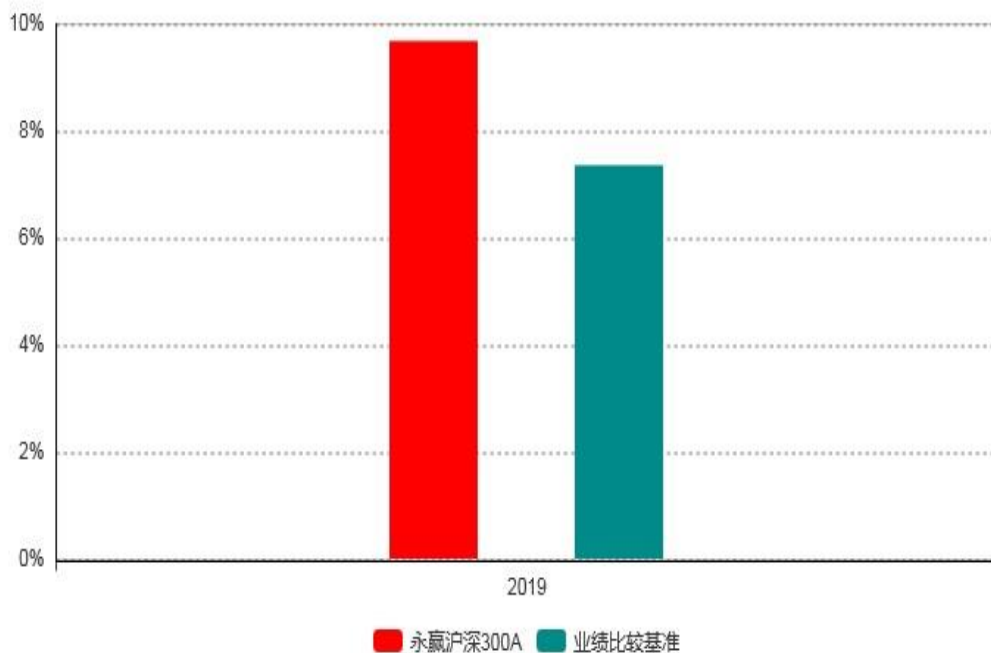
注：1、本基金合同生效日为 2019 年 7 月 9 日，截至本报告期末本基金合同生效未满 1 年。  
2、本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

永赢沪深300C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

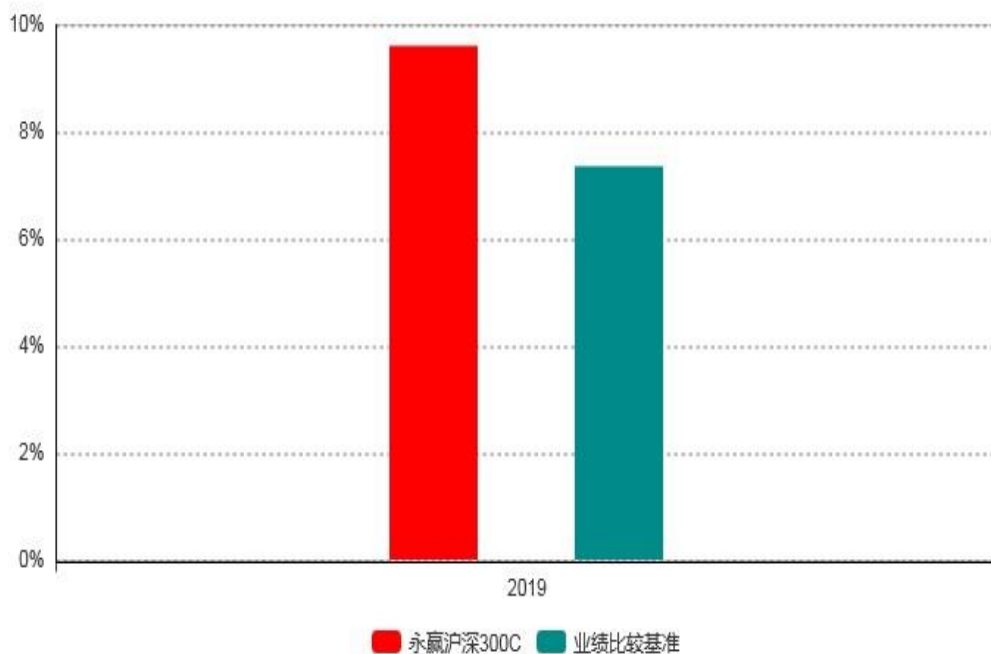


注：1、本基金合同生效日为 2019 年 7 月 9 日，截至本报告期末本基金合同生效未满 1 年。  
2、本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

### 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：图中列示的 2019 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 7 月 9 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。



注：图中列示的 2019 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 7 月 9 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金的合同生效日为2019年7月9日，截至2019年12月31日，本基金未进行过利润分配。

## § 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

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12月31日，本基金管理人共管理49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、永赢迅利中高等级短债债券型证券投资基金、永赢颐利债券型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、永赢中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、永赢泰利债券型证券投资基金、永赢卓利债券型证券投资基金、永赢悦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、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、永赢沪深300指数型发起式证券投资基金、永赢众利债券型证券投资基金、永赢同利债券型证券投资基金、永赢昌利债券型证券投资基金、

永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金、永赢创业板指数型发起式证券投资基金、永赢汇利六个月定期开放债券型证券投资基金、永赢淳利债券型证券投资基金、永赢高端制造混合型证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金。

#### 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	基金经理	2019-07-09	-	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。
万纯	基金经理	2019-07-17	-	5	万纯先生，北京大学硕士，5年证券相关从业经验，曾任中国结算技术部基金业务组经理助理；平安基金管理有限公司基金经理助理，现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理。

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合规守信情况的说明

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、《永赢沪深300指数型发起式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 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和内部制度，制定和修订了《公平交易制度》。

通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本基金管理人建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，本基金管理人建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限；投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预；基金经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。其次，本基金管理人建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同基金经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。另外，本基金管理人还建立机制要求公募基金经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资。

在交易执行方面，本基金管理人设立了独立于投资管理职能的交易部，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；此外，本基金管理人对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，交易部按照“时间优先、价格优先”的原则，采取“未委托数量比例法”，通过系统的公平交易模块实现公平交易；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以本基金管理人名义进行的交易，各基金经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认

的第三方信息)、交易对手和交易方式进行事后分析,确保交易得到公平和公允的执行;对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令,基金经理须提出申请并阐明具体原因,交由投资决策委员会进行严格的公平性审核;(4)严格禁止同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易(除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合或严格依据量化模型进行投资的组合外),确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生同日反向交易的,相关基金经理须向风险控制委员会提供决策依据并留存记录备查。

在日常监控和事后分析评估方面,风险管理部开展定期分析工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了对非公开发行股票申购、以本基金管理人名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控,以及对非连续竞价交易的价格公允性进行审查;事后分析评估上,风险管理部在每个季度的公平交易与异常交易稽核中,对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

#### 4.3.2 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,通过投资交易系统中的公平交易模块,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。

#### 4.3.3 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

自本基金2019年7月9日成立至2019年年底,A股市场在3000点附近上下震荡,板块表现分化明显。期间上证综指上涨0.2%,沪深300受益于逆周期调控加码、补库存拐点



临近、2020年专项债前置等，盈利逐期企稳改善，指数上涨4.0%；中小创因受益于宽松的货币政策和新一轮科技景气，估值业绩双修复，指数大幅上涨。行业层面，电子表现遥遥领先，建材、传媒、医药涨幅居前。

报告期内，本基金坚持既定的指数化投资策略，主要采取完全复制法进行投资，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重分配投资于每只股票的具体金额，进而形成股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。报告期内，本基金根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票发生增发或配股、成份股停牌或因法律法规原因被限制投资、市场流动性不足等情况，对股票投资组合进行调整，力争基金净值增长率与标的指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢沪深300A基金份额净值为1.0967元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.67%，同期业绩比较基准收益率为7.35%；截至报告期末永赢沪深300C基金份额净值为1.0960元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.60%，同期业绩比较基准收益率为7.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2020年，A股市场在经历2019年风险偏好大幅修复以后，PE估值已位于十年以来的历史中位数水平，我们认为2020年作为全面决胜小康年，政策稳增长动力较强，货币政策大概率仍将维持宽松，无风险利率下行下A股估值仍存在提升空间。其次，在金融供给侧改革背景下，提高直接融资占比，加大对实体经济支持力度，促进经济向“高质量”发展转型，均有助于宽货币向宽信用传导加速，部分行业将开启新一轮补库周期，基本面内生增长动能有望不断提升。预计未来一年行情主角将会根据估值和盈利的“性价比”不断进行切换，价值和成长板块有望交替成为行情主角。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2019年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障合规运作和投资者合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，持续开展了合规检查、内部审计、合规培训、制度修订、信息披露、反洗钱等工作。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作主要包括：

- 1、新规解读及监管要求的落实。2019年，监管机构发布了一系列法律法规，对公募基金投资运作及资管行业整体发展都产生深远影响，主要包括《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法（征求意见稿）》、《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投资信用衍生品指引》以及《关于做好公开募集证券投资

资基金投资顾问业务试点工作的通知》等。法规颁布后，公司第一时间组织相关人员对法规进行解读，并拟定针对性的落实方案，由各相关部门进行具体落实，同时定期对落实情况进行跟踪检查。

2、深入开展内部审计工作。内部审计是公司合规管理工作的重要组成部分，是公司风险防控机制中的一道重要防线。公司已设置了全面而完善的内部审计体系和流程，2019年公司内部审计体系主要由公司合规管理有效性评估、监管要求的各项例行内审、不定期开展各类专项审计以及投研人员行为操守的持续监控检查组成，前述内部审计工作作为有效防范操作风险及案件防控风险，为公司各项业务的稳步开展提供了全面、有效的保障。

3、强化合规培训。2019年，监管机构发布了诸多法律法规，为加强员工对法规的理解，强化员工在日常行为以及业务开展中的合规性，合规部组织多次面向不同对象，针对不同内容或法规的合规培训，包括针对新员工的合规培训，面向全员的合规宣导以及邀请外部律师就行业热点问题进行专项培训等。培训的内容以从业人员执业行为守则、新规要求、监管关注热点、行业风险事件为主，并通过多样化的方式提高了员工在合规培训中的参与度以及积极性。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，未发生会计师事务所出具非标准审计报告的情形。

#### 4.10 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

本报告期内，本基金托管人在对永赢沪深300指数型发起式证券投资基金的托管过程中，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，永赢沪深300指数型发起式证券投资基金的管理人——永赢基金管理有限公司在永赢沪深300指数型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对永赢基金管理有限公司编制和披露的永赢沪深300指数型发起式证券投资基金2019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	安永华明（2020）审字第61090672_B40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	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了永赢沪深300指数型发起式证券投资基金的财务报表，包括2019年12月31日的资产负

	<p>债表，2019年7月9日（基金合同生效日）至2019年12月31日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的永赢沪深300指数型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了永赢沪深300指数型发起式证券投资基金2019年12月31日的财务状况以及2019年7月9日（基金合同生效日）至2019年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于永赢沪深300指数型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>永赢沪深300指数型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护</p>

	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估永赢沪深300指数型发起式证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督永赢沪深300指数型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对永赢沪深300指数型发起式证券投资基金持续经</p>

	<p>营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致永赢沪深300指数型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	蒋燕华	费泽旭
会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼	
审计报告日期	2020-03-26	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：永赢沪深300指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	19,715,959.35
结算备付金		3,381,892.22
存出保证金		722,066.25
交易性金融资产	7.4.7.2	305,616,984.11
其中：股票投资		305,616,984.11

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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		7,045,508.26
应收利息	7.4.7.5	4,980.96
应收股利		-
应收申购款		556,401.10
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		337,043,792.25
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		8,074,643.60
应付管理人报酬		44,956.81
应付托管费		14,985.58
应付销售服务费		2,846.59
应付交易费用	7.4.7.7	242,513.64
应交税费		2,715.53
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	175,287.55

负债合计		8,557,949.30
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	299,545,441.46
未分配利润	7.4.7.10	28,940,401.49
所有者权益合计		328,485,842.95
负债和所有者权益总计		337,043,792.25

注：（1）报告截止日2019年12月31日，基金份额净值1.0966元，基金份额总额299,545,441.46份。其中A类基金份额净值1.0967元，份额总额268,486,762.10份；C类基金份额净值1.0960元，份额总额31,058,679.36份。

（2）本基金基金合同于2019年7月9日生效。

## 7.2 利润表

会计主体：永赢沪深300指数型发起式证券投资基金

本报告期：2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日
<b>一、收入</b>		30,637,815.54
1. 利息收入		80,084.06
其中：存款利息收入	7.4.7.11	80,084.06
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,464,391.51
其中：股票投资收益	7.4.7.12	8,527,249.54
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-



衍生工具收益	7.4.7.15	710,446.61
股利收益	7.4.7.16	1,226,695.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	20,041,298.69
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	52,041.28
<b>减：二、费用</b>		1,145,026.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	184,900.23
2. 托管费	7.4.10.2.2	61,633.39
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	7,528.29
4. 交易费用	7.4.7.19	696,905.67
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		2,557.61
7. 其他费用	7.4.7.20	191,501.65
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		29,492,788.70
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		29,492,788.70

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢沪深300指数型发起式证券投资基金

本报告期：2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	168,375,498.05	-	168,375,498.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	29,492,788.70	29,492,788.70

润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	131,169,943.41	-552,387.21	130,617,556.20
其中:1.基金申购款	417,567,126.37	13,400,543.05	430,967,669.42
2.基金赎回款	-286,397,182.96	-13,952,930.26	-300,350,113.22
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)	299,545,441.46	28,940,401.49	328,485,842.95

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:

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

永赢沪深300指数型发起式证券投资基金(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[2019]853号《关于准予永赢沪深300指数型发起式证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人永赢基金管理有限公司自2019年7月1日至2019年7月5日止期间向社会公开发行募集,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(2019)验字第61090672\_B13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2019年7月9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168,356,506.89元,在募集期间产生的存款利息为人民币18,991.16元,以上实收基金(本息)合计为人民币168,375,498.05元,折合168,375,498.05份基金份额,其中A类

基金份额167,410,623.76份，C类基金份额964,874.29份。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以沪深300指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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）。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

#### 7.4.2 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》、《公开募集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2号《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〈年度报告和中期报告〉》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。

#### 7.4.3 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12月31日的财务状况以及自2019年7月9日（基金合同生效日）起至2019年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2019年7月9日（基金合同生效日）起至2019年12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

##### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

#### (5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投

资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的每类基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金A类基金份额与C类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。



在遵守法律法规且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、注册登记机构可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告，且不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 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。

##### 7.4.6.2 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。

#### 7.4.6.3 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费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 7.4.6.4 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。

#### 7.4.6.5 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
活期存款	19,715,959.35
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	19,715,959.35

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	285,769,785.42	305,616,984.11	19,847,198.69

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		285,769,785.42	305,616,984.11	19,847,198.69

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2019年12月31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	-	-	-	-
其他衍生工具	5,980,500.00	-	-	注
合计	5,980,500.00	-	-	-

注：本期末2019年12月31日其他衍生工具具体如下：

项目	持仓量 (买/卖)	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
股指期货多头 合约	5.00	5,980,500.00	6,174,600.00	194,100.00
总额合计				194,100.00
减：可抵销 期货暂收款				194,100.00
股指期货投资 净额				0.00

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

**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**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应收活期存款利息	4,396.42
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	532.73
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	51.81
合计	4,980.96

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产余额。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	242,513.64

银行间市场应付交易费用	-
合计	242,513.64

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	160,000.00
应付指数使用费	15,287.55
合计	175,287.55

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 永赢沪深300A

金额单位：人民币元

项目 (永赢沪深300A)	本期2019年07月09日(基金合同生效日)至2019年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	167,410,623.76	167,410,623.76
本期申购	378,716,706.46	378,716,706.46
本期赎回(以“-”号填列)	-277,640,568.12	-277,640,568.12
本期末	268,486,762.10	268,486,762.10

##### 7.4.7.9.2 永赢沪深300C

金额单位：人民币元

项目 (永赢沪深300C)	本期2019年07月09日(基金合同生效日)至2019年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	964,874.29	964,874.29
本期申购	38,850,419.91	38,850,419.91

本期赎回（以“-”号填列）	-8,756,614.84	-8,756,614.84
本期末	31,058,679.36	31,058,679.36

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）本基金自2019年7月1日到2019年7月5日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币168,356,506.89元。根据《永赢沪深300指数型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币18,991.16元，在本基金成立后，折算为18,991.16份基金份额，划入基金份额持有人账户。以上实收基金（本息）合计为人民币168,375,498.05元，折合168,375,498.05份基金份额，其中A类167,410,623.76份，C类964,874.29份。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 永赢沪深300A

单位：人民币元

项目 (永赢沪深300A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	8,879,708.31	18,822,765.36	27,702,473.67
本期基金份额交易产生的变动数	1,233,223.87	-2,976,695.81	-1,743,471.94
其中：基金申购款	6,647,934.18	5,158,285.31	11,806,219.49
基金赎回款	-5,414,710.31	-8,134,981.12	-13,549,691.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,112,932.18	15,846,069.55	25,959,001.73

##### 7.4.7.10.2 永赢沪深300C

单位：人民币元

项目 (永赢沪深300C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	571,781.70	1,218,533.33	1,790,315.03
本期基金份额交易产生的变动数	577,236.24	613,848.49	1,191,084.73

其中：基金申购款	758,005.02	836,318.54	1,594,323.56
基金赎回款	-180,768.78	-222,470.05	-403,238.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,149,017.94	1,832,381.82	2,981,399.76

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日
活期存款利息收入	74,296.36
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	5,344.37
其他	443.33
合计	80,084.06

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出股票成交总额	173,473,260.68
减：卖出股票成本总额	164,946,011.14
买卖股票差价收入	8,527,249.54

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益



本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日
股指期货投资收益	710,446.61
合计	710,446.61

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,226,695.36
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	1,226,695.36

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	19,847,198.69
——股票投资	19,847,198.69
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	194,100.00
——权证投资	-
——股指期货合约	194,100.00
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	20,041,298.69

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金赎回费收入	52,041.28
合计	52,041.28

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	694,094.51
银行间市场交易费用	-
中金所交易费用	2,811.16
合计	696,905.67

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
指数使用费	24,653.34
账户维护费	3,000.00
汇划手续费	3,448.31
其他	400.00
合计	191,501.65

## 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

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	基金管理人、基金注册登记机构、基金发起人、

金”)	基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人
宁波银行股份有限公司 (“宁波银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
利安资金管理公司 (“利安资金”)	基金管理人的股东
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。

#### 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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

##### 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 2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	184,900.23

其中：支付销售机构的客户维护费	38,314.06
-----------------	-----------

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.15%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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	61,633.39

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.05%的年费率计提。计算方法如下：

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

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢沪深300A	永赢沪深300C	合计
宁波银行	0.00	228.04	228.04
永赢基金	0.00	6,062.08	6,062.08
合计	0.00	6,290.12	6,290.12

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

#### 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

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。

#### 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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 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

永赢沪深300A

份额单位：份

项目	本期
	2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金合同生效日（2019年07月09日）持有的基金份额	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出	0.00

总份额	
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.34%

永赢沪深300C

份额单位：份

项目	本期
	2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金合同生效日（2019年07月09日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

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。

#### 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

#### 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	本期
------	----

称	2019年07月09日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	19,715,959.35	74,296.36

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601658	邮储银行	2019-12-02	2020-06-10	新股限售	5.50	5.71	796,578	4,381,179.00	4,548,460.38	注
688111	金山办公	2019-11-11	2020-05-18	新股限售	45.86	128.63	14,659	672,261.74	1,885,587.17	注
601077	渝农商行	2019-10-16	2020-04-29	新股限售	7.36	6.26	147,778	1,087,646.08	925,090.28	注
688196	卓越新能	2019-11-13	2020-05-21	新股限售	42.93	38.37	11,131	477,853.83	427,096.47	注
6882	华特	2019	2020	新股	22.1	35.7	5,216	115,	186,	注



68	气体	-12-19	-06-29	限售	6	8		586.56	628.48	
688181	八亿时空	2019-12-27	2020-01-06	认购新发证券	43.98	43.98	3,827	168,311.46	168,311.46	-
002466	天齐锂业	2019-12-26	2020-01-03	认购新发证券-配股	8.75	30.18	4,950	43,312.50	149,391.00	-
002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	认购新发证券	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上上市公司公告为准。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603799	华友钴业	2019-12-31	重大事项停牌	39.39	2020-01-02	40.43	14,400	349,197.60	567,216.00	-

#### 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

截至本报告期末2019年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

### 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

本基金是股票型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型证券投资基金、货币市场基金和混合型证券投资基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数，以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以沪深300指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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）。本基金可参与融资业务和转融通证券出借交易。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。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会制订公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，

确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **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，因此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。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

- 1、本期末，本基金未持有短期债券投资；
- 2、本基金于2019年7月9日成立，无上年度末数据。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

- 1、本期末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券；
- 2、本基金于2019年7月9日成立，无上年度末数据。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

- 1、本期末，本基金未持有短期同业存单投资；
- 2、本基金于2019年7月9日成立，无上年度末数据。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

- 1、本期末，本基金未持有长期债券投资；
- 2、本基金于2019年7月9日成立，无上年度末数据。

##### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

- 1、本期末，本基金未持有长期资产支持证券投资；
- 2、本基金于2019年7月9日成立，无上年度末数据。

##### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

- 1、本期末，本基金未持有长期同业存单投资；
- 2、本基金于2019年7月9日成立，无上年度末数据。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

##### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

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，并对基金组合资产中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超过7个工作日可变现资产的可变现价值，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带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

本期末，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	19,715,959.35	-	-	-	-	-	19,715,959.35
结算备付金	1,076,303.38	-	-	-	-	2,305,588.84	3,381,892.22
存出保证金	104,606.25	-	-	-	-	617,460.00	722,066.25
交易性金融资产	-	-	-	-	-	305,616,984.11	305,616,984.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算	-	-	-	-	-	7,045,508.26	7,045,508.26

款							
应收利息	-	-	-	-	-	4,980.96	4,980.96
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	556,401.10	556,401.10
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	20,896,868.98	-	-	-	-	316,146,923.27	337,043,792.25
负债							
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	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,074,643.60	8,074,643.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	44,956.81	44,956.81
应付托管	-	-	-	-	-	14,985.58	14,985.58

费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,846.59	2,846.59
应付交易费用	-	-	-	-	-	242,513.64	242,513.64
应付税费	-	-	-	-	-	2,715.53	2,715.53
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	175,287.55	175,287.55
负债总计	-	-	-	-	-	8,557,949.30	8,557,949.30
利率敏感度缺口	20,896,868.98	-	-	-	-	307,588,973.97	328,485,842.95

注：本基金于2019年7月9日成立，无上年度末数据；

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

- 1、本报告期末，本基金未持有债券，无重大利率风险；
- 2、本基金于2019年7月9日成立，无上年度末数据。

#### 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。

## 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 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	305,616,984.11	93.04
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	305,616,984.11	93.04

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险	
	2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。	
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 2019年12月31日
	业绩比较基准增加1%	3,215,272.32
	业绩比较基准减少1%	-3,215,272.32

注：本基金于2019年7月9日成立，无上年度末数据。本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，



反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 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。

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2019年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币296,752,624.83元，属于第二层次的余额为人民币891,496.50元，属于第三层次的余额为人民币7,972,862.78元。

###### 7.4.14.1.2.2 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。

###### 7.4.14.1.2.3 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变动情况如下：

基金合同生效日人民币0.00元，2019年度转入第三层次人民币0.00元，转出第三层次人民币0.00元，当期计入损益的利得或损失总额人民币1,238,335.57元，购买人民币6,734,527.21元，卖出人民币0.00元，本期末人民币7,972,862.78元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动人民币1,238,335.57元。

##### 7.4.14.2 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。

##### 7.4.14.3 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。

##### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2020年3月26日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	305,616,984.11	90.68
	其中：股票	305,616,984.11	90.68
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	23,097,851.57	6.85
8	其他各项资产	8,328,956.57	2.47
9	合计	337,043,792.25	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（指数投资）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	4,357,420.00	1.33
B	采矿业	8,946,541.40	2.72
C	制造业	126,116,986.58	38.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,071,616.00	2.15
E	建筑业	7,557,678.00	2.30
F	批发和零售业	3,289,803.00	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	8,599,806.00	2.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	9,007,842.00	2.74

	术服务业		
J	金融业	98,886,613.44	30.10
K	房地产业	13,565,042.00	4.13
L	租赁和商务服务业	3,706,652.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	1,464,708.00	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	310,840.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	264,624.00	0.08
Q	卫生和社会工作	2,662,490.60	0.81
R	文化、体育和娱乐业	1,569,653.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	297,378,316.02	90.53

### 8.2.2 报告期末（积极投资）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	-	-
C	制造业	872,952.22	0.27
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	1,885,587.17	0.57
J	金融业	5,473,550.66	1.67
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	6,578.04	0.00
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	8,238,668.09	2.51

### 8.2.3 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投资股票。

### 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

#### 8.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	232,494	19,868,937.24	6.05
2	600519	贵州茅台	11,000	13,013,000.00	3.96
3	600036	招商银行	221,300	8,316,454.00	2.53
4	000651	格力电器	103,300	6,774,414.00	2.06
5	601166	兴业银行	312,100	6,179,580.00	1.88
6	000333	美的集团	104,400	6,081,300.00	1.85
7	600276	恒瑞医药	66,500	5,820,080.00	1.77
8	000858	五粮液	41,700	5,546,517.00	1.69
9	600030	中信证券	169,000	4,275,700.00	1.30
10	600887	伊利股份	130,900	4,050,046.00	1.23

11	000002	万 科 A	125,200	4,028,936.00	1.23
12	600900	长江电力	188,900	3,471,982.00	1.06
13	000001	平安银行	208,300	3,426,535.00	1.04
14	600016	民生银行	532,600	3,360,706.00	1.02
15	601328	交通银行	589,300	3,317,759.00	1.01
16	600000	浦发银行	252,000	3,117,240.00	0.95
17	601288	农业银行	821,300	3,030,597.00	0.92
18	601398	工商银行	462,500	2,719,500.00	0.83
19	300498	温氏股份	80,005	2,688,168.00	0.82
20	600837	海通证券	173,700	2,685,402.00	0.82
21	002415	海康威视	80,200	2,625,748.00	0.80
22	601601	中国太保	67,500	2,554,200.00	0.78
23	601668	中国建筑	450,200	2,530,124.00	0.77
24	002475	立讯精密	68,900	2,514,850.00	0.77
25	600048	保利地产	153,700	2,486,866.00	0.76
26	600585	海螺水泥	43,100	2,361,880.00	0.72
27	000725	京东方 A	508,300	2,307,682.00	0.70
28	600031	三一重工	126,500	2,156,825.00	0.66
29	601688	华泰证券	94,900	1,927,419.00	0.59
30	600309	万华化学	33,800	1,898,546.00	0.58
31	603288	海天味业	17,500	1,881,425.00	0.57
32	601888	中国国旅	21,100	1,876,845.00	0.57
33	300059	东方财富	115,600	1,823,012.00	0.55
34	000063	中兴通讯	51,300	1,815,507.00	0.55
35	601169	北京银行	317,500	1,803,400.00	0.55
36	600104	上汽集团	75,400	1,798,290.00	0.55
37	601211	国泰君安	96,800	1,789,832.00	0.54
38	002142	宁波银行	60,700	1,708,705.00	0.52
39	002714	牧原股份	18,800	1,669,252.00	0.51
40	601988	中国银行	451,900	1,667,511.00	0.51
41	600009	上海机场	20,800	1,638,000.00	0.50

42	000338	潍柴动力	102,900	1,634,052.00	0.50
43	600690	海尔智家	79,100	1,542,450.00	0.47
44	601818	光大银行	341,800	1,507,338.00	0.46
45	601766	中国中车	208,900	1,491,546.00	0.45
46	600028	中国石化	287,000	1,466,570.00	0.45
47	603259	药明康德	15,900	1,464,708.00	0.45
48	002304	洋河股份	13,100	1,447,550.00	0.44
49	601229	上海银行	152,400	1,446,276.00	0.44
50	600919	江苏银行	198,300	1,435,692.00	0.44
51	000661	长春高新	3,200	1,430,400.00	0.44
52	601012	隆基股份	56,800	1,410,344.00	0.43
53	002027	分众传媒	220,600	1,380,956.00	0.42
54	000568	泸州老窖	15,900	1,378,212.00	0.42
55	601899	紫金矿业	295,100	1,354,509.00	0.41
56	001979	招商蛇口	68,000	1,351,160.00	0.41
57	000100	TCL 集团	289,800	1,295,406.00	0.39
58	601088	中国神华	70,900	1,293,925.00	0.39
59	601628	中国人寿	35,900	1,251,833.00	0.38
60	601857	中国石油	208,400	1,214,972.00	0.37
61	600050	中国联通	199,600	1,175,644.00	0.36
62	002230	科大讯飞	33,200	1,144,736.00	0.35
63	600999	招商证券	61,600	1,126,664.00	0.34
64	601009	南京银行	127,640	1,119,402.80	0.34
65	600019	宝钢股份	191,400	1,098,636.00	0.33
66	600570	恒生电子	14,000	1,088,220.00	0.33
67	300015	爱尔眼科	26,860	1,062,581.60	0.32
68	600406	国电南瑞	49,700	1,052,646.00	0.32
69	601006	大秦铁路	127,800	1,049,238.00	0.32
70	601939	建设银行	144,200	1,042,566.00	0.32
71	601390	中国中铁	174,700	1,037,718.00	0.32
72	601989	中国重工	196,300	1,028,612.00	0.31

73	600015	华夏银行	132,300	1,014,741.00	0.31
74	000538	云南白药	11,200	1,001,616.00	0.30
75	601186	中国铁建	98,700	1,000,818.00	0.30
76	000166	申万宏源	193,300	989,696.00	0.30
77	002241	歌尔股份	48,800	972,096.00	0.30
78	000776	广发证券	63,800	967,846.00	0.29
79	600703	三安光电	52,600	965,736.00	0.29
80	002594	比亚迪	19,500	929,565.00	0.28
81	000876	新希望	45,400	905,730.00	0.28
82	601336	新华保险	18,100	889,615.00	0.27
83	600741	华域汽车	33,900	881,061.00	0.27
84	603986	兆易创新	4,300	881,027.00	0.27
85	002044	美年健康	59,100	879,999.00	0.27
86	300142	沃森生物	26,500	859,660.00	0.26
87	600958	东方证券	77,100	829,596.00	0.25
88	600352	浙江龙盛	56,100	811,767.00	0.25
89	002024	苏宁易购	80,000	808,800.00	0.25
90	601225	陕西煤业	86,000	773,140.00	0.24
91	002236	大华股份	38,800	771,344.00	0.23
92	600588	用友网络	27,000	766,800.00	0.23
93	601901	方正证券	88,300	765,561.00	0.23
94	300003	乐普医疗	23,100	764,148.00	0.23
95	300136	信维通信	16,800	762,384.00	0.23
96	601155	新城控股	19,400	751,168.00	0.23
97	600340	华夏幸福	25,900	743,330.00	0.23
98	000157	中联重科	111,200	742,816.00	0.23
99	002008	大族激光	18,500	740,000.00	0.23
100	600547	山东黄金	22,620	737,864.40	0.22
101	600346	恒力石化	45,400	730,032.00	0.22
102	600660	福耀玻璃	30,300	726,897.00	0.22
103	600436	片仔癀	6,600	725,142.00	0.22

104	300347	泰格医药	11,400	719,910.00	0.22
105	601377	兴业证券	100,800	713,664.00	0.22
106	601669	中国电建	163,800	710,892.00	0.22
107	002352	顺丰控股	19,100	710,329.00	0.22
108	002202	金风科技	59,330	708,993.50	0.22
109	600383	金地集团	48,740	706,730.00	0.22
110	601138	工业富联	38,500	703,395.00	0.21
111	300124	汇川技术	22,500	689,400.00	0.21
112	000069	华侨城 A	88,200	687,078.00	0.21
113	600886	国投电力	73,100	671,058.00	0.20
114	601985	中国核电	133,700	668,500.00	0.20
115	600029	南方航空	92,400	663,432.00	0.20
116	002736	国信证券	52,800	662,640.00	0.20
117	603993	洛阳钼业	151,600	660,976.00	0.20
118	600010	包钢股份	488,800	645,216.00	0.20
119	002001	新 和 成	27,710	644,534.60	0.20
120	002007	华兰生物	18,300	643,245.00	0.20
121	603160	汇顶科技	3,100	639,530.00	0.19
122	002456	欧菲光	40,900	638,040.00	0.19
123	000895	双汇发展	21,600	627,048.00	0.19
124	002466	天齐锂业	20,750	626,235.00	0.19
125	601111	中国国航	64,300	623,067.00	0.19
126	601877	正泰电器	23,200	621,760.00	0.19
127	601933	永辉超市	82,300	620,542.00	0.19
128	002311	海大集团	17,200	619,200.00	0.19
129	601108	财通证券	54,200	614,628.00	0.19
130	002555	三七互娱	22,800	614,004.00	0.19
131	000783	长江证券	83,200	594,048.00	0.18
132	600795	国电电力	252,400	590,616.00	0.18
133	002602	世纪华通	51,400	587,502.00	0.18
134	300144	宋城演艺	19,000	587,290.00	0.18



135	600196	复星医药	21,800	579,880.00	0.18
136	002460	赣锋锂业	16,600	578,178.00	0.18
137	600018	上港集团	99,600	574,692.00	0.17
138	603799	华友钴业	14,400	567,216.00	0.17
139	600705	中航资本	115,900	562,115.00	0.17
140	000938	紫光股份	17,700	559,320.00	0.17
141	600115	东方航空	96,200	558,922.00	0.17
142	600271	航天信息	24,100	558,397.00	0.17
143	000425	徐工机械	101,100	553,017.00	0.17
144	600061	国投资本	36,400	551,096.00	0.17
145	601788	光大证券	41,900	548,890.00	0.17
146	600438	通威股份	41,700	547,521.00	0.17
147	603501	韦尔股份	3,800	544,920.00	0.17
148	600606	绿地控股	78,400	544,880.00	0.17
149	600089	特变电工	79,900	531,335.00	0.16
150	601997	贵阳银行	55,500	530,580.00	0.16
151	600809	山西汾酒	5,900	529,230.00	0.16
152	600011	华能国际	94,400	526,752.00	0.16
153	600177	雅戈尔	75,400	525,538.00	0.16
154	300033	同花顺	4,800	523,728.00	0.16
155	300122	智飞生物	10,500	521,430.00	0.16
156	002050	三花智控	29,840	517,127.20	0.16
157	601555	东吴证券	51,400	513,486.00	0.16
158	600183	生益科技	24,500	512,540.00	0.16
159	600111	北方稀土	46,900	508,396.00	0.15
160	002410	广联达	14,900	506,302.00	0.15
161	002271	东方雨虹	19,200	505,152.00	0.15
162	002624	完美世界	11,400	503,196.00	0.15
163	002493	荣盛石化	40,572	502,687.08	0.15
164	300408	三环集团	22,500	501,300.00	0.15
165	601600	中国铝业	140,400	497,016.00	0.15

166	600176	中国巨石	45,300	493,770.00	0.15
167	000768	中航飞机	29,700	486,486.00	0.15
168	002120	韵达股份	14,600	486,180.00	0.15
169	600109	国金证券	51,900	482,670.00	0.15
170	603019	中科曙光	13,800	477,204.00	0.15
171	600487	亨通光电	28,800	468,288.00	0.14
172	000786	北新建材	18,300	465,735.00	0.14
173	601800	中国交建	50,700	464,412.00	0.14
174	000963	华东医药	19,000	463,220.00	0.14
175	601607	上海医药	25,000	459,250.00	0.14
176	002179	中航光电	11,700	457,002.00	0.14
177	600100	同方股份	51,300	449,901.00	0.14
178	002422	科伦药业	18,800	441,612.00	0.13
179	600522	中天科技	52,900	439,070.00	0.13
180	601919	中远海控	82,900	436,883.00	0.13
181	600332	白云山	12,200	434,442.00	0.13
182	601618	中国中冶	153,100	428,680.00	0.13
183	600516	方大炭素	35,200	428,032.00	0.13
184	600221	海航控股	247,300	427,829.00	0.13
185	000961	中南建设	40,000	422,000.00	0.13
186	600893	航发动力	19,400	420,592.00	0.13
187	600498	烽火通信	15,300	419,985.00	0.13
188	000625	长安汽车	41,800	419,254.00	0.13
189	600637	东方明珠	44,300	414,648.00	0.13
190	600066	宇通客车	28,600	407,550.00	0.12
191	300413	芒果超媒	11,650	407,284.00	0.12
192	600926	杭州银行	44,300	405,788.00	0.12
193	601998	中信银行	65,500	404,135.00	0.12
194	000728	国元证券	43,400	402,318.00	0.12
195	300017	网宿科技	41,900	399,307.00	0.12
196	600068	葛洲坝	59,600	398,128.00	0.12

197	603899	晨光文具	8,100	394,794.00	0.12
198	600004	白云机场	22,500	392,625.00	0.12
199	601727	上海电气	78,500	390,930.00	0.12
200	600867	通化东宝	30,800	389,620.00	0.12
201	601198	东兴证券	29,500	387,630.00	0.12
202	600362	江西铜业	22,600	382,618.00	0.12
203	600674	川投能源	38,000	374,300.00	0.11
204	002673	西部证券	37,900	371,420.00	0.11
205	002146	荣盛发展	37,500	368,625.00	0.11
206	000423	东阿阿胶	10,100	357,237.00	0.11
207	601021	春秋航空	8,100	355,509.00	0.11
208	002508	老板电器	10,500	355,005.00	0.11
209	000656	金科股份	46,100	354,048.00	0.11
210	000596	古井贡酒	2,600	353,392.00	0.11
211	600583	海油工程	47,600	351,288.00	0.11
212	601838	成都银行	38,700	351,009.00	0.11
213	600208	新湖中宝	92,300	348,894.00	0.11
214	600023	浙能电力	87,900	348,084.00	0.11
215	600219	南山铝业	154,000	344,960.00	0.11
216	000703	恒逸石化	24,700	343,824.00	0.10
217	601117	中国化学	53,200	342,608.00	0.10
218	002601	龙鳞佰利	22,100	340,119.00	0.10
219	603833	欧派家居	2,900	339,300.00	0.10
220	600085	同仁堂	12,000	338,160.00	0.10
221	600170	上海建工	95,300	337,362.00	0.10
222	300024	机器人	23,500	329,000.00	0.10
223	002739	万达电影	18,100	328,515.00	0.10
224	002916	深南电路	2,300	326,830.00	0.10
225	601018	宁波港	85,300	324,140.00	0.10
226	601881	中国银河	27,800	322,758.00	0.10
227	601878	浙商证券	28,700	319,431.00	0.10

228	002252	上海莱士	42,900	318,318.00	0.10
229	600489	中金黄金	37,400	317,152.00	0.10
230	000413	东旭光电	94,100	316,176.00	0.10
231	000630	铜陵有色	135,500	315,715.00	0.10
232	600369	西南证券	60,700	315,033.00	0.10
233	600038	中直股份	6,600	314,886.00	0.10
234	600482	中国动力	15,595	311,900.00	0.09
235	300070	碧水源	40,900	310,840.00	0.09
236	002081	金螳螂	34,800	306,936.00	0.09
237	600535	天士力	19,600	302,232.00	0.09
238	601066	中信建投	9,900	300,960.00	0.09
239	000627	天茂集团	42,600	299,904.00	0.09
240	000671	阳光城	35,100	298,350.00	0.09
241	600760	中航沈飞	9,200	290,720.00	0.09
242	002032	苏泊尔	3,600	276,408.00	0.08
243	600118	中国卫星	12,900	275,673.00	0.08
244	600153	建发股份	30,500	274,195.00	0.08
245	603156	养元饮品	9,400	272,882.00	0.08
246	000629	攀钢钒钛	92,700	270,684.00	0.08
247	002153	石基信息	6,900	269,100.00	0.08
248	601992	金隅集团	71,300	265,949.00	0.08
249	002607	中公教育	14,800	264,624.00	0.08
250	600655	豫园股份	33,500	262,640.00	0.08
251	600663	陆家嘴	19,200	259,392.00	0.08
252	600027	华电国际	69,800	256,166.00	0.08
253	002938	鹏鼎控股	5,700	255,930.00	0.08
254	000723	美锦能源	26,500	249,895.00	0.08
255	601808	中海油服	12,900	247,680.00	0.08
256	600977	中国电影	16,200	246,564.00	0.08
257	002558	巨人网络	13,200	238,392.00	0.07
258	300433	蓝思科技	17,100	236,322.00	0.07

259	000709	河钢股份	91,000	234,780.00	0.07
260	601238	广汽集团	20,000	233,800.00	0.07
261	600297	广汇汽车	70,100	228,526.00	0.07
262	601633	长城汽车	25,800	228,330.00	0.07
263	601216	君正集团	72,600	227,238.00	0.07
264	600398	海澜之家	28,500	218,880.00	0.07
265	002773	康弘药业	5,900	218,123.00	0.07
266	600848	上海临港	8,700	213,585.00	0.07
267	600816	安信信托	47,400	210,456.00	0.06
268	002411	延安必康	13,400	209,442.00	0.06
269	601360	三六零	8,900	209,239.00	0.06
270	601577	长沙银行	22,500	204,075.00	0.06
271	600188	兖州煤业	19,300	203,808.00	0.06
272	601898	中煤能源	39,400	197,788.00	0.06
273	002010	传化智联	28,300	197,534.00	0.06
274	002294	信立泰	9,200	183,448.00	0.06
275	601319	中国人保	23,200	176,088.00	0.05
276	600733	北汽蓝谷	30,000	175,200.00	0.05
277	000898	鞍钢股份	51,600	172,860.00	0.05
278	600998	九州通	12,200	172,630.00	0.05
279	600566	济川药业	7,000	169,260.00	0.05
280	600372	中航电子	11,600	165,184.00	0.05
281	600989	宝丰能源	17,300	164,523.00	0.05
282	600025	华能水电	38,900	164,158.00	0.05
283	600233	圆通速递	12,500	158,125.00	0.05
284	002841	视源股份	1,800	154,260.00	0.05
285	000415	渤海租赁	39,600	150,480.00	0.05
286	601236	红塔证券	8,900	149,253.00	0.05
287	002468	申通快递	6,600	128,700.00	0.04
288	600968	海油发展	43,300	126,869.00	0.04
289	601212	白银有色	31,700	116,656.00	0.04

290	601698	中国卫通	9,000	101,880.00	0.03
291	002939	长城证券	7,300	101,178.00	0.03
292	601828	美凯龙	8,900	100,837.00	0.03
293	603260	合盛硅业	3,260	96,072.20	0.03
294	002945	华林证券	6,000	89,640.00	0.03
295	600390	五矿资本	10,640	87,886.40	0.03
296	002958	青农商行	13,400	86,698.00	0.03
297	600928	西安银行	10,800	83,916.00	0.03
298	601162	天风证券	11,400	83,904.00	0.03
299	601298	青岛港	10,500	72,135.00	0.02
300	600299	安迪苏	6,500	71,890.00	0.02

### 8.3.2 期末积极投资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	601658	邮储银行	796,578	4,548,460.38	1.38
2	688111	金山办公	14,659	1,885,587.17	0.57
3	601077	渝农商行	147,778	925,090.28	0.28
4	688196	卓越新能	11,131	427,096.47	0.13
5	688268	华特气体	5,216	186,628.48	0.06
6	688181	八亿时空	3,827	168,311.46	0.05
7	603995	甬金股份	1,888	51,278.08	0.02
8	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
9	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
10	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	-

### 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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	33,041,058.00	10.06
2	600519	贵州茅台	17,149,582.60	5.22
3	600036	招商银行	12,896,059.26	3.93
4	601166	兴业银行	9,422,627.91	2.87
5	000651	格力电器	9,421,085.00	2.87
6	000333	美的集团	9,114,835.54	2.77
7	000858	五粮液	8,445,528.40	2.57
8	600276	恒瑞医药	8,151,023.67	2.48
9	600887	伊利股份	6,434,113.47	1.96
10	601658	邮储银行	6,258,824.00	1.91
11	600030	中信证券	6,161,551.00	1.88
12	601328	交通银行	5,424,857.00	1.65
13	600016	民生银行	5,233,658.00	1.59
14	000002	万科 A	5,224,043.00	1.59
15	600900	长江电力	5,047,013.69	1.54
16	300498	温氏股份	4,992,900.45	1.52
17	000001	平安银行	4,872,783.00	1.48
18	600000	浦发银行	4,852,402.19	1.48
19	601288	农业银行	4,779,628.00	1.46
20	601398	工商银行	4,264,709.00	1.30

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	12,678,651.98	3.86
2	600519	贵州茅台	5,798,560.00	1.77

3	600036	招商银行	5,059,477.09	1.54
4	000651	格力电器	3,850,763.00	1.17
5	601166	兴业银行	3,730,812.00	1.14
6	000333	美的集团	3,622,589.00	1.10
7	600276	恒瑞医药	3,400,743.00	1.04
8	000858	五粮液	3,236,152.00	0.99
9	600030	中信证券	2,418,706.00	0.74
10	600887	伊利股份	2,401,284.00	0.73
11	600016	民生银行	2,060,577.00	0.63
12	601328	交通银行	2,060,462.00	0.63
13	600000	浦发银行	1,919,968.00	0.58
14	601658	邮储银行	1,911,784.00	0.58
15	601288	农业银行	1,857,859.00	0.57
16	000001	平安银行	1,853,379.00	0.56
17	300498	温氏股份	1,773,565.00	0.54
18	000002	万科A	1,754,395.00	0.53
19	601398	工商银行	1,665,064.00	0.51
20	600900	长江电力	1,641,345.00	0.50

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。

#### 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	450,715,796.56
卖出股票收入（成交）总额	173,473,260.68

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。

#### 8.5 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。



**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**

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2006	沪深300股指期货2006合约	5	6,174,600.00	194,100.00	-
公允价值变动总额合计(元)					194,100.00
股指期货投资本期收益(元)					731,760.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					194,100.00

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。根据基金合同规定，本基金可投资于以标的指数为基础资产的股指期货，并在相关法律法规的限制下，起到配合基金日常投资管理需要，降低交易成本和跟踪误差的作用。报告期内，本基金严格遵守既定投资政策和投资目的，进行股指期货投资。

**8.11 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。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 本报告期内，基金投资的前十名证券的发行主体中国邮政储蓄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。

8.12.2 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。

### 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	722,066.25
2	应收证券清算款	7,045,508.26
3	应收股利	-
4	应收利息	4,980.96
5	应收申购款	556,401.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,328,956.57

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601658	邮储银行	4,548,460.38	1.38	新股限售
2	688111	金山办公	1,885,587.17	0.57	新股限售
3	601077	渝农商行	925,090.28	0.28	新股限售

4	688196	卓越新能	427,096.47	0.13	新股限售
5	688268	华特气体	186,628.48	0.06	新股限售

### 8.12.6 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。

## § 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
永赢沪深300A	3,456	77,687.14	158,134,196.52	58.89 83%	110,352,565.58	41.101 7%
永赢沪深300C	508	61,139.13	26,984,415.31	86.88 20%	4,074,264.05	13.118 0%
合计	3,964	75,566.46	185,118,611.83	61.79 98%	114,426,829.63	38.200 2%

### 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	永赢沪深300A	102,631.89	0.04%
	永赢沪深300C	93,960.25	0.30%
	合计	196,592.14	0.07%

### 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	永赢沪深300A	0~10
	永赢沪深300C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	永赢沪深300A	0
	永赢沪深300C	0
	合计	0

#### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	3.34%	10,000,000.00	3.34%	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,000.00	3.34%	10,000,000.00	3.34%	自合同生效之日起不少于三年

#### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢沪深300A	永赢沪深300C
基金合同生效日(2019年07月09)	167,410,623.76	964,874.29

日)基金份额总额		
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	378,716,706.46	38,850,419.91
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	277,640,568.12	8,756,614.84
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	268,486,762.10	31,058,679.36

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,经永赢基金管理有限公司董事会审议通过,聘任黄庆先生担任公司首席信息官职务。本基金管理人已于2019年11月30日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站以及中国证监会电子披露网站登载了《永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。上述变更事项已按有关规定向监管机构报备。

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 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。报告期内应支付给聘任会计师事务所的报酬为60,000.00元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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等情况。

## 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	
中金公司	2	611,023,855.08	100.00%	443,004.24	100.00%	-

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。

### 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
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金份额发售公告	证券时报、公司网站	2019-06-21
2	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金招募说明书	证券时报、公司网站	2019-06-21
3	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金托管协议	证券时报、公司网站	2019-06-21
4	永赢沪深300指数型发起式	证券时报、公司网站	2019-06-21

	证券投资基金基金合同摘要		
5	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同	证券时报、公司网站	2019-06-21
6	永赢基金管理有限公司关于永赢沪深300指数型发起式证券投资基金开展直销认购费率优惠活动的公告	证券时报、公司网站	2019-06-26
7	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、公司网站	2019-07-10
8	永赢基金管理有限公司关于新增交通银行股份有限公司为永赢沪深300指数型发起式证券投资基金代销机构并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、公司网站	2019-07-13
9	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	证券时报、公司网站	2019-07-13
10	永赢基金管理有限公司关于永赢沪深300指数型发起式证券投资基金A类份额开展直销申购费率优惠活动的公告	证券时报、公司网站	2019-07-15
11	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金增聘基金经理的公告	证券时报、公司网站	2019-07-18
12	永赢基金管理有限公司关于永赢沪深300指数型发起式证券投资基金可投资于科创板股票的公告	证券时报、公司网站	2019-07-27
13	永赢基金管理有限公司关于新增西藏东方财富证券股份有限公司为代销机构并参与	证券时报、公司网站	2019-08-16

	其费率优惠活动的公告		
14	永赢基金管理有限公司关于新增北京百度百盈基金销售有限公司为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、公司网站	2019-08-30
15	永赢基金管理有限公司关于新增北京肯特瑞基金销售有限公司为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2019-09-04
16	永赢基金管理有限公司关于新增农业银行为旗下部分基金代销机构并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2019-10-08
17	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金2019年第3季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2019-10-24
18	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要（2019年第1号）	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2019-11-01
19	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金更新招募说明书（2019年第1号）	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2019-11-01
20	永赢基金管理有限公司关于永赢沪深300指数型发起式证券投资基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同及托管协议的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2019-11-01
21	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2019-11-01
22	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金托管协议	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2019-11-01
23	永赢沪深300指数型发起式	证券时报、中国证监会基金	2019-11-15



	证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）、转换转入业务的公告	电子披露网站、公司网站	
24	永赢基金管理有限公司关于新增江苏银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2019-12-13
25	永赢基金管理有限公司关于新增安信证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参与其费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2019-12-19
26	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要（2019年第2号）	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2019-12-28
27	永赢沪深300指数型发起式证券投资基金更新招募说明书（2019年第2号）	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2019-12-28

## § 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

本基金本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。

### 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. 中国证监会核准永赢沪深300指数型发起式证券投资基金募集的文件；
2. 《永赢沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢沪深300指数型发起式证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢沪深300指数型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新（如有）；
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

地点为管理人地址：上海市浦东新区世纪大道210号21世纪中心大厦27楼

### 13.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：[www.maxwealthfund.com](http://www.maxwealthfund.com)。

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：021-51690111

永赢基金管理有限公司  
二〇二〇年三月二十六日