

---

# 永赢昌益债券型证券投资基金

## 2020 年中期报告

2020 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:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年01月01日起至2020年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	20
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48

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	48
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢昌益债券型证券投资基金	
基金简称	永赢昌益债券	
基金主代码	006660	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年11月29日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,248,369,110.59份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢昌益债券A	永赢昌益债券C
下属分级基金的交易代码	006660	006661
报告期末下属分级基金的份额总额	4,248,368,478.46份	632.13份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金主要投资于债券资产，在有效控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。</p>
投资策略	<p>本基金将通过分析宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，综合运用类属配置策略、久期策略、收益率曲线策略、信用策略等多种投资策略，力求规避风险并实现基金资产的增值保值。</p> <p>1、类属配置策略</p> <p>本基金将综合分析各类属相对收益情况、利差变化状况、信用风险评级、流动性风险管理等因素来确定各类属配置比例，发掘具有较好投资价值的投资品种，增持相对低估并能给组合带来相对较高回报的类属，减持相对高估并能给组合带来相对较低回报的类属。</p> <p>2、久期策略</p>

本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。

### 3、收益率曲线策略

本基金资产组合中的长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。本基金在确定固定收益资产组合平均久期的基础上，将结合收益率曲线变化的预测，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。

### 4、信用策略

本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，主要关注信用债收益率受信用利差曲线变动趋势和信用变化两方面影响，相应地采用以下两种投资策略：

(1) 信用利差曲线变化策略：首先分析经济周期和相关市场变化情况，其次分析标的债券市场容量、结构、流动性等变化趋势，最后综合分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定本基金信用债分行业投资比例。

(2) 信用变化策略：信用债信用等级发生变化后，本基金将采用最新信用级别所对应的信用利差曲线对债券进行重新定价。

本基金将根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

### 5、息差策略

息差策略操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否

	<p>存在息差空间，从而确定是否进行正回购。进行息差策略操作时，基金管理人将严格控制回购比例以及信用风险和期限错配风险。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中国债券综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	永赢基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
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	400-805-8888	95595
传真	021-51690177	010-63639132
注册地址	浙江省宁波市鄞州区中山东路466号	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	200120	100033
法定代表人	马宇晖	李晓鹏

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露	证券时报
------------	------

露报纸名称	
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金中期报告备置地点	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
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(2020年01月01日-2020年06月30日)	
	永赢昌益债券A	永赢昌益债券C
本期已实现收益	122,956,027.22	3.34
本期利润	113,982,248.81	1.35
加权平均基金份额本期利润	0.0189	0.0081
本期加权平均净值利润率	1.83%	0.79%
本期基金份额净值增长率	1.21%	1.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
期末可供分配利润	28,458,406.39	3.86
期末可供分配基金份额利润	0.0067	0.0061
期末基金资产净值	4,276,826,884.85	635.99
期末基金份额净值	1.0067	1.0061
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	



基金份额累计净值增长率	4.51%	4.17%
-------------	-------	-------

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。

### 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

##### 永赢昌益债券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
过去一个月	-0.85%	0.14%	-0.94%	0.12%	0.09%	0.02%
过去三个月	-0.72%	0.15%	-1.04%	0.12%	0.32%	0.03%
过去六个月	1.21%	0.12%	0.79%	0.11%	0.42%	0.01%
过去一年	3.00%	0.09%	1.87%	0.08%	1.13%	0.01%
自基金合同生效起至今	4.51%	0.08%	2.86%	0.07%	1.65%	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：中国债券综合全价指数收益率。

##### 永赢昌益债券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
过去一个月	-0.87%	0.14%	-0.94%	0.12%	0.07%	0.02%
过去三个月	-0.74%	0.15%	-1.04%	0.12%	0.30%	0.03%
过去六个月	1.26%	0.12%	0.79%	0.11%	0.47%	0.01%

过去一年	3.10%	0.09%	1.87%	0.08%	1.23%	0.01%
自基金合同生效起至今	4.17%	0.08%	2.86%	0.07%	1.31%	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：中国债券综合全价指数收益率。

### 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

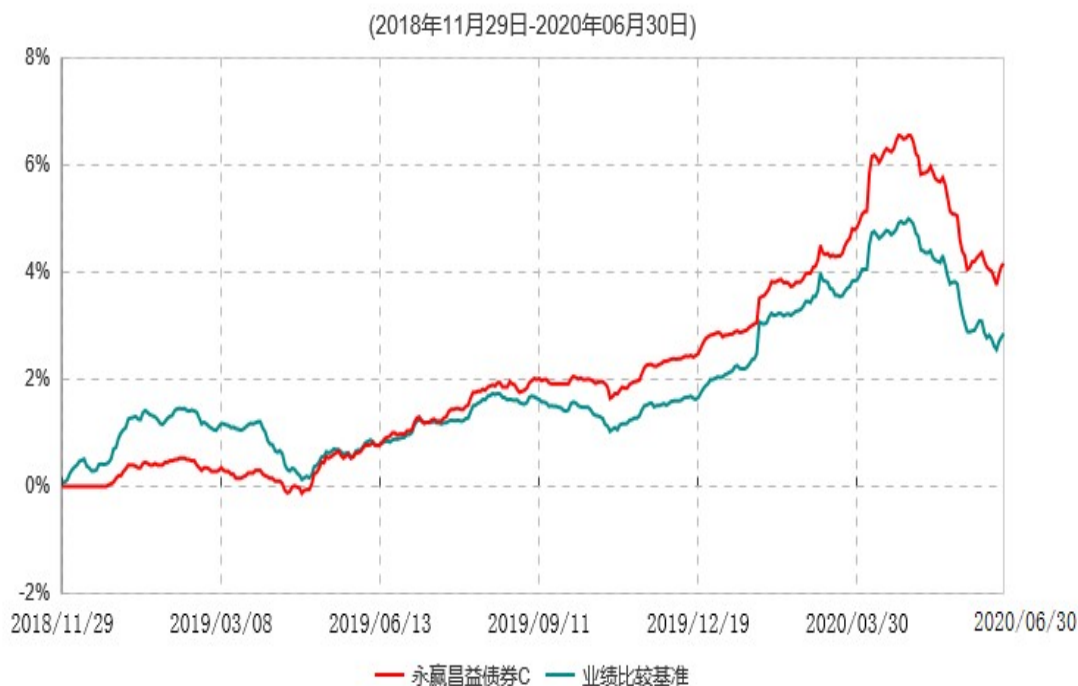
永赢昌益债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年11月29日-2020年06月30日)



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。

永赢昌益债券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



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%，华侨银行有限公司持股28.51%。

截止2020年6月30日，本基金管理人共管理58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、永赢元利债券型证券投资基金、永赢乾元三年定期开放混合型证券投资基金、永赢易弘债券型证券投资基金、永赢科技驱动混合型证券投资基金、永赢股息优选混合型证券投资基金、永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金、永赢中债-1-5年国开行债券指数证券投资基金、永赢竞争力精选混合型发起式证券投资基金、永赢医药健康股票型证券投资基金。

#### 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		
徐翔	副总经理/ 基金经理	2019-02-27	2020-05-21	14	徐翔先生，经济学硕士，14年证券相关从业经验。曾任国家开发银行总行资金局交易中心交易员；德意志银行（中国）有限公司环球市场部交易员；澳新银行（中国）有限公司全球金融市场部交易总

					监；德意志银行（中国）有限公司环球市场部交易主管；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。
江凌	基金经理	2019-11-27	-	5	江凌女士，金融学硕士，5年证券相关从业经验。曾任常熟农商银行金融市场部交易员，现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。

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、《永赢昌益债券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

上半年经济以疫情为节点，经历了跳水、反弹走势，其中2月是疫情爆发后的封锁防控月份，经济基本处于暂停状态，经济总量和各个板块均跳水式下跌；3月开始经济逐步解封，3月到4月前半期修复斜率大但不及预期；4月中下旬开始到6月，随着基建、地产的快速修复，经济持续修复，逐步超出市场预期。物价方面则全面、持续下行：CPI自年初高点5%以上，快速下行，到季末的时候已跌至2.5%；PPI开年就在通缩边缘，1-2季度通缩显著加剧，一度跌至-3.7%，季末水平为-3%；GDP平减指数从去年4季度的3.42%跌至今年2季度的2.04%，名义GDP修复速度要显著慢于实际GDP。

政策方面，发生较大变化，4月初以调低超额准备金利率为标志，货币政策进入加大逆周期调控阶段；但进入5月份之后，政策强调打击空转套利、防风险，政策放松力度显著收紧，资金利率持续攀升，回到政策基准利率附近。

操作上，春节前夕，由于避险情绪快速升温，我们在节前逐步增持长债。2月以后，疫情在国外全面爆发，美联储两度紧急降息，美债收益率大幅下行；国内方面，疫情好转迹象愈发明显，流动性持续宽裕，隔夜利率水平大幅下行。我们也根据市场节奏，对长久期利率债进行波段交易以增厚组合收益，期间获得了不错的收益。4月之后短端收益率逐渐下行至资金利率附近，甚至频繁出现利率倒挂，因而我们逐步对中短端进行了减持操作。在二季度的调整中，由于5年期以内的短端调整幅度明显大于长端，叠加短久期利率债本身流动性相对较弱，为了增强组合的整体流动性，我们对部分仓位进行了置换，确保组合流动性稳定。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢昌益债券A基金份额净值为1.0067元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.21%，同期业绩比较基准收益率为0.79%；截至报告期末永赢昌益债券C基金份额净值为1.0061元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.26%，同期业绩比较基准收益率为0.79%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场后续展望来看，下半年整个基本面总体上预计仍在修复之中，但修复的动能从大部分依靠基建、地产逆周期托底，更多的转向消费、制造业投资等内生动能的修复。这种结构变化会导致整个基本面面临修复速率放缓、结构中偏弱且存在稳就业压力等问题。且到了四季度，一则要关注通缩趋势可能的显著演化，另一则要关注市场和政策预期的提前演化：关注明年整个经济前高后低的走势。

政策方面，仍然继续强调金融系统的让利，但防风险的基调不会放松，预计仍有边际再宽松动作，但难以再现疫情期间的大宽松。

#### 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

根据基金合同规定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。2020年03月12日，本基金进行了收益分配：其中A类基金每10份基金份额分红0.250元，共计分配利润167,892,174.38元；C类基金每10份基金份额分红0.229元，共计分配利润3.12元；2020年06月17日，本基金进行了收益分配：其中A类基金每10份基金份额分红0.080元，共计分配利润33,986,943.46元；C类基金每10份基金份额分红0.079元，共计分配利润1.68元，符合基金合同的规定。

#### 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在永赢昌益债券型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《永赢昌益债券型证券投资基金2020年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：永赢昌益债券型证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日



<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	734,417.74	3,138,781.97
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,087,415,000.00	5,497,750,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,087,415,000.00	5,497,750,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	816,347,224.51
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	62,854,097.75	88,184,689.34
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,151,003,515.49	6,405,420,695.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年06月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		872,038,326.97	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,056,605.77	1,628,914.96
应付托管费		352,201.92	542,971.68

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	98,593.88	84,078.67
应交税费		-	-
应付利息		394,867.73	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	235,398.38	216,000.00
负债合计		874,175,994.65	2,471,965.31
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	4,248,369,110.59	6,233,341,935.91
未分配利润	6.4.7.10	28,458,410.25	169,606,794.60
所有者权益合计		4,276,827,520.84	6,402,948,730.51
负债和所有者权益总计		5,151,003,515.49	6,405,420,695.82

注：报告截止日2020年6月30日，基金份额净值1.0067元，基金份额总额4,248,369,110.59份，其中A类基金份额净值1.0067元，份额总额4,248,368,478.46份；C类基金份额净值1.0061元，份额总额632.13份。

## 6.2 利润表

会计主体：永赢昌益债券型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年06月30日
<b>一、收入</b>		135,427,543.71	40,831,806.59
1. 利息收入		105,539,870.03	44,504,856.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	23,868.51	97,204.07
债券利息收入		104,728,993.61	40,936,455.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		787,007.91	3,471,197.41

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）		38,861,454.08	-4,454,808.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	38,861,454.08	-4,454,808.26
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,973,780.40	781,758.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		21,445,293.55	6,971,091.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	9,292,448.79	4,163,332.11
2. 托管费	6.4.10.2. 2	3,097,482.90	1,387,777.41
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	62,825.00	49,900.00
5. 利息支出		8,874,138.48	1,278,256.06
其中：卖出回购金融资产 支出		8,874,138.48	1,278,256.06
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	118,398.38	91,826.38

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		113,982,250.16	33,860,714.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		113,982,250.16	33,860,714.63

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢昌益债券型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020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）	6,233,341,935.91	169,606,794.60	6,402,948,730.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	113,982,250.16	113,982,250.16
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）	-1,984,972,825.32	-53,251,511.87	-2,038,224,337.19
其中：1. 基金申购款	1,061,105,160.95	38,894,289.41	1,099,999,450.36
2. 基金赎回款	-3,046,077,986.27	-92,145,801.28	-3,138,223,787.55
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）	-	-201,879,122.64	-201,879,122.64
五、期末所有者权益（基金净值）	4,248,369,110.59	28,458,410.25	4,276,827,520.84
项 目	上年度可比期间		

	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)	200,012,310.55	493,445.63	200,505,756.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	33,860,714.63	33,860,714.63
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)	5,051,937,823.01	42,923,044.46	5,094,860,867.47
其中：1. 基金申购款	6,143,706,185.81	56,286,856.09	6,199,993,041.90
2. 基金赎回款	-1,091,768,362.80	-13,363,811.63	-1,105,132,174.43
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)	5,251,950,133.56	77,277,204.72	5,329,227,338.28

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

黄庆

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

永赢昌益债券型证券投资基金（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]1811号文《关于准予永赢昌益债券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向社会公开募集，基金合同于2018年11月29日正式生效，首次设立募集规模为200,012,330.46份基金份

额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金基金份额分为A类和C类基金份额。对于A类基金份额，投资者认购/申购时收取认购/申购费用，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；对于C类基金份额，投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、资产支持证券、债券回购、协议存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、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相关规定。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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：本基金投资债券的比例不低于基金资产的80%，每个交易日日终保持现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%，以备支付基金份额持有人的赎回款项。

本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数收益率。

#### 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》、《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。

#### 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2020年6月30日的财务状况以及自2020年1月1日起至2020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 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。

##### 6.4.6.2 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[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[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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
活期存款	734,417.74
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	734,417.74

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动



股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场		-	-
	银行间市场	5,071,236,370.06	5,087,415,000.00	16,178,629.94
	合计	5,071,236,370.06	5,087,415,000.00	16,178,629.94
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,071,236,370.06	5,087,415,000.00	16,178,629.94

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	267.62
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	-
应收债券利息	62,853,830.13
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	-
合计	62,854,097.75

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	98,593.88
合计	98,593.88

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30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	235,398.38
合计	235,398.38

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 永赢昌益债券A

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
----	---------------------------

(永赢昌益债券A)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	6,233,341,797.78	6,233,341,797.78
本期申购	1,061,104,666.95	1,061,104,666.95
本期赎回(以“-”号填列)	-3,046,077,986.27	-3,046,077,986.27
本期末	4,248,368,478.46	4,248,368,478.46

## 6.4.7.9.2 永赢昌益债券C

金额单位：人民币元

项目 (永赢昌益债券C)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	138.13	138.13
本期申购	494.00	494.00
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	632.13	632.13

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

## 6.4.7.10.1 永赢昌益债券A

单位：人民币元

项目 (永赢昌益债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	141,457,684.98	28,149,106.31	169,606,791.29
本期利润	122,956,027.22	-8,973,778.41	113,982,248.81
本期基金份额交易产生的变动数	-17,978,308.11	-35,273,207.76	-53,251,515.87
其中：基金申购款	18,356,910.21	20,537,375.20	38,894,285.41
基金赎回款	-36,335,218.32	-55,810,582.96	-92,145,801.28
本期已分配利润	-201,879,117.84	-	-201,879,117.84
本期末	44,556,286.25	-16,097,879.86	28,458,406.39

## 6.4.7.10.2 永赢昌益债券C

单位：人民币元

项目 (永赢昌益债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2.81	0.50	3.31
本期利润	3.34	-1.99	1.35
本期基金份额交易产生的变动数	5.37	-1.37	4.00
其中：基金申购款	5.37	-1.37	4.00
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-4.80	-	-4.80
本期末	6.72	-2.86	3.86

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	23,868.51
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	-
其他	-
合计	23,868.51

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	38,861,454.08
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	38,861,454.08

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	13,269,350,526.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,123,698,685.92
减：应收利息总额	106,790,386.62
买卖债券差价收入	38,861,454.08

#### 6.4.7.13.3 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。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 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。

##### 6.4.7.14.2 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。

##### 6.4.7.14.3 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。

##### 6.4.7.14.4 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。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	-8,973,780.40
——股票投资	-
——债券投资	-8,973,780.40
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	-8,973,780.40

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	62,825.00
合计	62,825.00

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	118,398.38

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据永赢基金管理有限公司股东会会议决议，并经中国证券监督管理委员会核准，本公司原股东利安资金管理公司（Lion Global Investors Limited）将其持有的本公司股权转让给华侨银行有限公司（Oversea-Chinese Banking Corporation Limited），股权结构发生变更。基金管理人已于2020年8月7日发布相关公告。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期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。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
永赢基金管理有限公司（“永赢基金”）	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	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

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 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。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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回购交易。

###### 6.4.10.1.5 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。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,292,448.79	4,163,332.11
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.30%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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,097,482.90	1,387,777.41

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%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。

#### 6.4.10.2.3 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 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢昌益债券A	永赢昌益债券C	合计
永赢基金	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	0.00
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢昌益债券A	永赢昌益债券C	合计
永赢基金	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	0.00

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的应支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值0.20%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2020年01月01日至2020年06月30日						
银行间市场交 易的各关联方 名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支 出
光大银行	-	-	-	-	982,073,0 00.00	229,64 2.10
上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日						
银行间市场交 易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支 出
-	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未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。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

永赢昌益债券A

关联方名称	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019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
宁波银行	0.00	0.00%	100,000,000.00	1.6043%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资永赢昌益债券C。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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
光大银行	734,417.74	23,868.51	2,264,570.68	74,790.86

## 6.4.10.7 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。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 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

永赢昌益债券A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2020-03-12	2020-03-12	0.250	167,892,174.38	-	167,892,174.38	-

2	2020-06-17	2020-06-17	0.080	33,986,943.46	-	33,986,943.46	-
合计			0.330	201,879,117.84	-	201,879,117.84	-

永赢昌益债券C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2020-03-12	2020-03-12	0.229	3.12	-	3.12	-
2	2020-06-17	2020-06-17	0.079	1.68	-	1.68	-
合计			0.308	4.80	-	4.80	-

#### 6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2020年6月30日止，本基金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人民币872,038,326.97元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
180412	18农发12	2020-07-01	101.21	722,000	73,073,620.00
190403	19农发03	2020-07-01	101.06	2,047,000	206,869,820.00
190407	19农发07	2020-07-01	101.06	6,000,000	606,360,000.00
合计				8,769,000	886,303,440.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020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。

#### 6.4.12.4 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、资产支持证券、债券回购、协议存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、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相关规定。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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，使本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

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。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,042,047,000.00	790,896,000.00
合计	1,042,047,000.00	790,896,000.00

注：本期末及上年度末，未评级的短期债券均是政策性金融债。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有短期同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日

AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	4,045,368,000.00	4,706,854,000.00
合计	4,045,368,000.00	4,706,854,000.00

注：本期末及上年度末，未评级的长期债券均是国债和政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单投资。

#### 6.4.13.3 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。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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6.4.12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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金主要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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年 06月30 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	734,417.74	-	-	-	-	-	734,417.74
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	1,042,047.00	3,714,996.00	330,372,000.00	-	5,087,415.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-



应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	62,854,097.75	62,854,097.75
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	734,417.74	-	1,042,047.00	3,714,996.00	330,372,000.00	62,854,097.75	5,151,003,515.49
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	872,038,326.97	-	-	-	-	-	872,038,326.97
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,056,605.77	1,056,605.77
应付托管费	-	-	-	-	-	352,201.92	352,201.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	98,593.88	98,593.88
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	394,867.73	394,867.73
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	235,398.38	235,398.38
负债总计	872,038,326.97	-	-	-	-	2,137,667.68	874,175,994.65
利率敏感度缺口	-871,303,909.23	-	1,042,047.00	3,714,996.00	330,372,000.00	60,716,430.07	4,276,827,520.84
上年度	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

末2019 年12月 31日							
资产							
银行存款	3,138,781.97	-	-	-	-	-	3,138,781.97
结算备 付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保 证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性 金融资 产	-	-	790,896,000.0 0	4,294,483,00 0.00	412,371,000. 00	-	5,497,750,00 0.00
衍生金 融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返 售金融 资产	816,347,224.5 1	-	-	-	-	-	816,347,224.5 1
应收证 券清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收利 息	-	-	-	-	-	88,184,689. 34	88,184,689.34
应收股 利	-	-	-	-	-	-	-
应收申 购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资 产	-	-	-	-	-	-	-
资产总 计	819,486,006. 48	-	790,896,000.0 0	4,294,483,00 0.00	412,371,000. 00	88,184,689. 34	6,405,420,69 5.82
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	-	-	-	-	-	-	-
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	1,628,914.9 6	1,628,914.96
应付托 管费	-	-	-	-	-	542,971.68	542,971.68

应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	84,078.67	84,078.67
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	216,000.00	216,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,471,965.31	2,471,965.31
利率敏感度缺口	819,486,006.48	-	790,896,000.00	4,294,483,000.00	412,371,000.00	85,712,724.03	6,402,948,730.51

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率曲线向上、向下平行移动50个基点		
假设	2. 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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	市场利率平行上升50个基点	-51,568,846.62	-68,273,877.35
	市场利率平行下降50个基点	51,568,846.62	68,273,877.35

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

## 6.4.14.1 公允价值

## 6.4.14.1.1 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。

## 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2020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0.00元，属于第二层次的余额为人民币

5,087,415,000.00元，属于第三层次余额为人民币0.00元

## 6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

## 6.4.14.1.2.3 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未发生变动。

## 6.4.14.2 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。

## 6.4.14.3 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。

## 6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2020年8月28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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,087,415,000.00	98.77
	其中：债券	5,087,415,000.00	98.77

	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	734,417.74	0.01
8	其他各项资产	62,854,097.75	1.22
9	合计	5,151,003,515.49	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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期内未投资股票。

### 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

本基金本报告期内未投资股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

1	国家债券	41,028,000.00	0.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,046,387,000.00	117.99
	其中：政策性金融债	5,046,387,000.00	117.99
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,087,415,000.00	118.95

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	200403	20农发03	6,600,000	653,928,000.00	15.29
2	190407	19农发07	6,000,000	606,360,000.00	14.18
3	190403	19农发03	6,000,000	606,360,000.00	14.18
4	190306	19进出06	5,500,000	558,360,000.00	13.06
5	180412	18农发12	5,500,000	556,655,000.00	13.02

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

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**

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没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	62,854,097.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,854,097.75

**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**

本基金本报告期末未持有股票。

**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

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 昌益 债券A	297	14,304,270. 97	4,248,365,157. 61	99.99 99%	3,320.85	0.000 1%
永赢 昌益 债券C	47	13.45	0.00	0.000 0%	632.13	100.00 00%
合计	344	12,349,910. 21	4,248,365,157. 61	99.99 99%	3,952.98	0.000 1%

### 8.2 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	永赢昌益债券A	1,113.35	0.00%
	永赢昌益债券C	602.23	95.27%
	合计	1,715.58	0.00%

### 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	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	永赢昌益债券A	0~10



和研究部门负责人持有本开放式基金	永赢昌益债券C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	永赢昌益债券A	0~10
	永赢昌益债券C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	永赢昌益债券A	永赢昌益债券C
基金合同生效日(2018年11月29日)基金份额总额	200,012,290.46	40.00
本报告期期初基金份额总额	6,233,341,797.78	138.13
本报告期基金总申购份额	1,061,104,666.95	494.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,046,077,986.27	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,248,368,478.46	632.13

## § 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，经永赢基金管理有限公司董事会审议通过，聘任郑凌云先生担任公司总经理助理职务。本基金管理人已于2020年5月29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基金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。

本报告期内，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，未发生涉及基金管理人、基金财产、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等情况。

#### 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	
宏信证券	2	-	-	-	-	-

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
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	永赢昌益债券型证券投资基金2019年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2020-01-18
2	永赢昌益债券型证券投资基金分红公告（2020年第1次）	中国证监会规定媒介	2020-03-12
3	永赢昌益债券型证券投资基金2019年年度报告	中国证监会规定媒介	2020-03-26
4	永赢昌益债券型证券投资基金2020年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2020-04-22
5	永赢昌益债券型证券投资基金的基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2020-05-22
6	永赢昌益债券型证券投资基金更新招募说明书（2020年第1号）	中国证监会规定媒介	2020-05-22
7	永赢昌益债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2020年第1号）	中国证监会规定媒介	2020-05-22
8	永赢昌益债券型证券投资基金分红公告（2020年第2次）	中国证监会规定媒介	2020-06-17

## § 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	20200101 - 20200518	2,463,732,680.19	482,345,166.89	2,946,077,847.08	0.00	0.00%
	2	20200521 - 20200630	992,259,376.86	0.00	0.00	992,259,376.86	23.36%
	3	20200101 - 20200630	1,487,227,215.96	0.00	0.00	1,487,227,215.96	35.01%
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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准永赢昌益债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《永赢昌益债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《永赢昌益债券型证券投资基金托管协议》；
4. 《永赢昌益债券型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。

### 12.2 存放地点

地点为管理人地址：上海市浦东新区世纪大道210号二十一世纪中心大厦27楼

### 12.3 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：400-805-8888

永赢基金管理有限公司  
二〇二〇年八月三十一日